

# **HSBC Global Investment Funds**

## **Geprüfter Jahresbericht für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024**



R.C.S. Luxemburg B 25 087  
4, rue Peternelchen,  
L-2370 Howald,  
**Großherzogtum Luxemburg**

**Geprüfter Jahresbericht für das Geschäftsjahr vom 1. April 2023 bis zum 31. März 2024**

Société d'Investissement à Capital Variable (SICAV), Luxemburg

### **Informationen zum Vertrieb der Anteile von HSBC Global Investment Funds in oder von der Schweiz aus**

Rechtsvertreter der Gesellschaft in der Schweiz: HSBC Global Asset Management (Switzerland) Ltd., Gartenstrasse 26, Postfach, CH-8002 Zürich. Der Prospekt, das Basisinformationsblatt, die Satzung und die Jahres- und Halbjahresberichte der Gesellschaft sind auf Anfrage kostenlos vom gesetzlichen Vertreter in der Schweiz erhältlich. Eine Aufstellung sämtlicher im Berichtszeitraum für jeden Teilfonds der Gesellschaft getätigten Transaktionen ist kostenlos vom gesetzlichen Vertreter in der Schweiz erhältlich.

### **Zusätzliche Hinweise für in Hongkong ansässige Personen im Hinblick auf HSBC Global Investment Funds**

Die folgenden Teilfonds von HSBC Global Investment Funds, auf die in diesem Dokument Bezug genommen wird, sind in Hongkong nicht zugelassen und für in Hongkong ansässige Personen nicht verfügbar:

|  |   |
|--|---|
| Asia Bond  | Global Emerging Markets ESG Local Debt        |
| Asia High Yield Bond   | Global Emerging Markets Local Debt            |
| Asian Currencies Bond  | Global Emerging Markets Local Debt            |
| Brazil Bond  | Global Equity Circular Economy                |
| China A-Shares Equity  | Global ESG Corporate Bond                     |
| Corporate Euro Bond Fixed Term 2027<br>(aufgelegt zum 30. Juni 2023)                           | Global Green Bond                             |
| Euro Bond Total Return   | Global High Yield ESG Bond                    |
| Euro Credit Bond   | Global High Yield Securitised Credit Bond     |
| Euroland Growth  | Global Inflation Linked Bond                  |
| Frontier Markets   | Global Securitised Credit Bond                |
| GEM Debt Total Return  | Global Sustainable Equity Income              |
| Global Bond Total Return   | Global Sustainable Long Term Equity           |
| Global Credit Floating Rate Fixed Term Bond 20231 -<br>2023 - 1 (geschlossen zum 5. Juli 2023) | Mexico Equity (geschlossen zum 28. Juli 2023) |
| Global Credit Floating Rate Fixed Term Bond<br>2023 - 2 (geschlossen zum 29. Dezember 2023)    | Multi-Asset Style Factors                     |
| Global Emerging Markets Corporate Sustainable Bond   | Multi-Strategy Target Return                  |
| Global Emerging Markets ESG Bond   | RMB Fixed Income                              |
|  | Singapore Dollar Income Bond                  |
|  | Turkey Equity                                 |

### **Aufstellung der Änderungen des Anlageportfolios**

Eine Auflistung sämtlicher Käufe und Verkäufe aller Fonds, die im hier betrachteten Geschäftsjahr durchgeführt wurden, ist auf Anfrage am eingetragenen Sitz der Gesellschaft erhältlich.

Die Zeichnung von Fondsanteilen auf der Grundlage von Jahres- bzw. Halbjahresabschlüssen ist nicht möglich. Zeichnungen sind nur gültig, wenn sie auf Grundlage des aktuellen Verkaufsprospekts, ergänzt durch den letzten Jahres- und den aktuellsten Halbjahresbericht erfolgen, falls dieser jüngeren Datums ist als der letzte Jahresbericht.

Der aktuelle Prospekt, die Satzung sowie der Zwischenbericht und geprüfte Jahresbericht können kostenlos bei der Verwaltungsgesellschaft angefordert werden.

# Inhaltsverzeichnis

|   |     |
|---|-----|
| Verwaltungsrat  | 3   |
| Management und Verwaltung   | 4   |
| Bericht des Verwaltungsrats   | 7   |
| Bericht des Anlageberaters  | 12  |
| Prüfbericht   | 18  |
| Aufstellung des NettoVermögens zum 31. März 2024  | 21  |
| Wichtige Kennzahlen zum 31. März 2024   | 35  |
| Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderungen des NettoVermögens für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024  | 59  |
| Inhaltsverzeichnis: Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024  | 74  |
| Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024  | 75  |
| Aufstellung der Derivate  | 370 |
| Erläuterungen zum Abschluss für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024   | 454 |
| Anhang I (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Besteuerung der Gesellschaft (ausländische Staaten)   | 496 |
| Anhang II (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – UK SORP Offenlegung  | 499 |
| Anhang III (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Handelstage des Fonds   | 510 |
| Anhang IV (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Feiertagskalender des Fonds für das Jahr 2024  | 511 |
| Anhang V (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Anlageberater   | 529 |
| Anhang VI (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Risikomanagement   | 533 |
| Anhang VII (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte („SFT-Verordnung“)   | 543 |
| Anhang VIII (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Veröffentlichung der Performancedaten für in der Schweiz vertriebene Teilfonds – Information für Schweizer Anleger | 572 |
| Anhang IX (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor („SFDR“)                | 597 |

# Verwaltungsrat

- ▶ **Anthony Jeffs**, (Vorsitzender), Global Head of Product  
HSBC Global Asset Management (UK) Limited,  
Im Vereinigte Königreich von Großbritannien und Nordirland ansässig.
- ▶ **Dr. Michael Böhm**, Chief Operating Officer  
Head of Global Fund Services, Alternatives (seit 1. Juni 2023)  
HSBC Global Asset Management (Deutschland) GmbH,  
In der Bundesrepublik Deutschland ansässig.
- ▶ **Jean de Courrèges**, unabhängiges Verwaltungsratsmitglied  
(ausgeschieden mit Wirkung zum 31. März 2024)  
Im Großherzogtum Luxemburg ansässig.
- ▶ **Eimear Cowhey**, unabhängiges Verwaltungsratsmitglied  
In der Republik Irland ansässig.
- ▶ **John Li**, unabhängiges Verwaltungsratsmitglied  
(ausgeschieden mit Wirkung zum 30. September 2023)  
Im Großherzogtum Luxemburg ansässig.
- ▶ **Matteo Pardi**, Head of International Markets  
HSBC Global Asset Management (France), Niederlassung Italien,  
In der Republik Italien ansässig.
- ▶ **Timothy Palmer**, Non-Executive Director  
(ernannt mit Wirkung zum 2. Oktober 2023)  
Im Vereinigte Königreich von Großbritannien und Nordirland ansässig.
- ▶ **Carine Feipel**, Unabhängiges Verwaltungsratsmitglied  
(ernannt mit Wirkung zum 2. April 2024)  
Im Großherzogtum Luxemburg ansässig.

# Management und Verwaltung

|  |  |
|--|--|
| <b>Eingetragener Sitz</b>  | 4, rue Peternelchen,<br>L-2370 Howald,<br>Großherzogtum Luxemburg.   |
| <b>Verwaltungsgesellschaft</b>   | HSBC Investment Funds (Luxembourg) S.A.<br>18, boulevard de Kockelscheuer,<br>L-1821 Luxemburg,<br>Großherzogtum Luxemburg.  |
| <b>Verwaltungsstelle, Depotbank,<br/>Hauptzahlstelle, Register- und<br/>Transferstelle</b> | HSBC Continental Europe, Luxembourg<br>18, boulevard de Kockelscheuer,<br>L-1821 Luxemburg,<br>Großherzogtum Luxemburg.  |
| <b>Domizilstelle und Vertretung der<br/>Gesellschaft</b>                                   | ONE Corporate<br>4, rue Peternelchen,<br>Cubus C3,<br>L-2370 Howald,<br>Großherzogtum Luxemburg.   |
| <b>Anlageberater</b>   | HSBC Global Asset Management (France) Limited<br>Immeuble Cœur Défense – Tour A,<br>110 Esplanade du Général de Gaulle – La Défense 4,<br>75419 Paris Cedex 08, Frankreich.<br><br>HSBC Global Asset Management (Hong Kong) Limited<br>Level 22, HSBC Main Building, 1 Queen's Road, Central, Hongkong SAR.<br><br>HSBC Global Asset Management (Mexico) S.A.<br>Paseo de la Reforma no. 347, P. 15, Col. Cuauhtémoc, C.P. 06500,<br>México, D.F., Mexiko.<br><br>HSBC Global Asset Management (UK) Limited<br>8, Canada Square, London E14 5HQ, Vereinigtes Königreich.<br><br>HSBC Global Asset Management (USA) Inc.<br>452 Fifth Avenue, 7th Floor, New York, NY 10018, USA.<br><br>HSBC Global Portfoy Yonetimi A.S.<br>Esentepe Mahallesi, Büyükdere Caddesi, No:128, 34394 Sisli,<br>Istanbul, Türkei.<br><br>HSBC Global Asset Management (Singapore) Limited<br>10 Marina Boulevard, Marina Bay Financial Centre, Tower 2 Level 46-01,<br>Singapore 018983. |
| <b>Unteranlageberater</b>  | HSBC Global Asset Management (Switzerland) Limited<br>Gartenstrasse 26 CH – 8002 Zürich.   |

# Management und Verwaltung (Fortsetzung)

## Unteranlageberater

HSBC Global Asset Management (Singapore) Limited  
10 Marina Boulevard, Marina Bay Financial Centre, Tower 2 Level 46-01,  
Singapur 018983.

## Vertriebsstellen

HSBC Investment Funds (Luxembourg) S.A.  
18, boulevard de Kockelscheuer,  
L-1821 Luxemburg,  
Großherzogtum Luxemburg.

HSBC Investment Funds (Hong Kong) Limited  
Level 22, HSBC Main Building, 1 Queen's Road, Central, Hongkong SAR.

HSBC Global Asset Management (France) Limited  
Immeuble Coeur Défense – Tour A,  
110 Esplanade du Général de Gaulle – La Défense 4,  
75419 Paris Cedex 08, Frankreich.

HSBC Trinkaus & Burkhardt AG  
Königsallee 21/23, D-40212 Düsseldorf, Deutschland.

HSBC Global Asset Management (UK) Limited  
8 Canada Square, London E14 5HQ, Vereinigtes Königreich.

HSBC Global Asset Management (Malta) Limited  
Operations Centre, 80 Mill Street, Qormi, QRM 3101, Malta.

HSBC Global Asset Management (Bermuda) Limited  
37 Front Street, 2nd Floor, Hamilton HM 11, Bermuda.

HSBC Securities (USA), Inc.  
452 Fifth Avenue, New York, 10018, USA.

HSBC Saudi Arabia  
7267 Olaya-AlMurooj, Riyadh 12283-225,  
Königreich Saudi-Arabien.

HSBC Bank Australia  
Level 36, Tower 1, International Towers Sydney, 100 Barangaroo Avenue,  
Sydney NSW 2000, Australien.

HSBC Global Asset Management (Japan) Limited  
HSBC Building 11-1, Nihonbashi 3-Chome, Chuo-Ku,  
Tokio, 103-0027, Japan.

HSBC Global Asset Management (Singapore) Limited  
10 Marina Boulevard, Marina Bay Financial Centre, Tower 2 Level 46-01,  
Singapur 018983.

# Management und Verwaltung (Fortsetzung)

|  |  |
|--|--|
| <b>Zahlstelle in der Schweiz</b>         | HSBC Private Bank (Suisse) S.A.<br>Quai des Bergues 9-17, Case Postale 2888,<br>CH-1211 Genf 1, Schweiz.                         |
| <b>Zahlstelle in Hongkong</b>            | The Hong Kong and Shanghai Banking Corporation Limited<br>HSBC Main Building, 1 Queen's Road Central,<br>Hongkong SAR.           |
| <b>Vertreter und Zahlstelle in Polen</b> | HSBC Continental Europe, Niederlassung Polen<br>Rondo ONZ 1, 00-124 Warschau,<br>Polen.  |
| <b>Abschlussprüfer</b>                   | PricewaterhouseCoopers, Société Coopérative<br>2, rue Gerhard Mercator, B.P. 1443, L-1014 Luxemburg,<br>Großherzogtum Luxemburg. |
| <b>Rechtsberater</b>                     | Elvinger Hoss Prussen, S.A.<br>2, place Winston Churchill, L-1340 Luxemburg,<br>Großherzogtum Luxemburg.                         |



# Bericht des Verwaltungsrats

## Kommentare des Verwaltungsrats

Der Verwaltungsrat legt den geprüften Jahresbericht und Jahresabschluss für HSBC Global Investment Funds (die „Gesellschaft“) für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024 vor.

## Die Gesellschaft

Die „Gesellschaft“ wurde als eine Investmentgesellschaft mit variablem Kapital nach dem Recht des Großherzogtums Luxemburg gegründet und als „Umbrella-Fonds“ mit einer Reihe von Teilfonds organisiert. Jeder dieser Teilfonds hat individuelle Anlagerichtlinien und -beschränkungen. Die Gesellschaft hat aktuell 76 Teilfonds im Umlauf. Im Verlauf des Jahres stieg das Gesamtvermögen der Gesellschaft von 30,66 Mrd. USD auf 33,25 Mrd. USD zum Jahresende.

Die Gesellschaft ist gemäß der aktualisierten Richtlinie 2009/65/EG vom 13. Juli 2009 als Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren qualifiziert und darf somit in EU-Mitgliedstaaten angeboten werden, sofern sie in anderen Ländern als dem Großherzogtum Luxemburg registriert wird. Außerdem kann die Registrierung der Gesellschaft und ihrer Teilfonds auch für andere nicht europäische Länder beantragt werden. Die Gesellschaft und ihre Teilfonds sind aktuell zum Handel und Vertrieb im Großherzogtum Luxemburg und folgenden Ländern registriert: Bahrain, Belgien, Brunei, Chile, Dänemark, Deutschland, Finnland, Frankreich, Griechenland, Hongkong, Irland, Italien, Japan, Jersey, Katar, Korea, Libanon, Macau, Malta, Niederlande, Norwegen, Österreich, Oman, Polen, Portugal, Saudi-Arabien, Schweden, Schweiz, Singapur, Spanien, Taiwan, Tschechische Republik, Vereinigte Arabische Emirate und Vereinigtes Königreich

## Aufgaben des Verwaltungsrats

Die Aufgaben und Verantwortungsbereiche des Verwaltungsrats der Gesellschaft (der „Verwaltungsrat“) werden ausschließlich nach Luxemburger Recht geregelt. In Bezug auf diesen Jahresbericht sind die Pflichten des Verwaltungsrats durch das allgemeine Unternehmensrecht und das Gesetz vom 19. Dezember 2002 über, unter anderem, die Rechnungslegung und die Jahresberichte für Organismen, in der jeweils gültigen Fassung, und durch das Gesetz vom 17. Dezember 2010 über Organismen für gemeinsame Anlagen, in der jeweils gültigen Fassung, (das „Gesetz von 2010“) geregelt. Seit dem 1. Juli 2011 untersteht die Gesellschaft Teil I des Gesetzes von 2010, mit dem die Richtlinie 2009/65/EG in luxemburgisches Gesetz umgesetzt worden ist.

## Vergütungspolitik

HSBC Investment Funds (Luxembourg) S.A. („HIFL“) hat eine Vergütungspolitik gemäß Richtlinie 2014/91/EU des Europäischen Parlaments und des Rates vom 23. Juli 2014 zur Änderung der Richtlinie 2009/65/EG zur Koordinierung der Rechts- und Verwaltungsvorschriften betreffend bestimmte Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (OGAW) im Hinblick auf die Aufgaben der Verwahrstelle, die Vergütungspolitik und Sanktionen (die „OGAW-V-Richtlinie“) umgesetzt, die am 1. Juni 2016 durch das Luxemburger Gesetz vom 10. Mai 2016 in Luxemburger Recht umgesetzt wurde.

Die Vergütungspolitik, die vom Verwaltungsrat von HIFL genehmigt wurde, beinhaltet Maßnahmen zur Vermeidung von Interessenkonflikten und ist bestrebt, ein ordentliches und effektives Risikomanagement zu fördern, das weder zur Übernahme von Risiken ermutigt, die mit den Risikoprofilen und der Satzung der Gesellschaft nicht vereinbar sind, noch die HIFL daran hindert, pflichtgemäß im besten Interesse der Gesellschaft zu handeln.

Die Vergütungspolitik, die beschreibt, wie die Vergütungs- und Zusatzleistungen berechnet werden, ist unter [www.global.assetmanagement.hsbc.com/about-us/governance-structure](http://www.global.assetmanagement.hsbc.com/about-us/governance-structure) oder auf Anforderung bei HIFL verfügbar.

Folgende Gesamtsumme wurde während des 12-Monats-Zeitraums zum 31. März 2024 von HIFL als Vergütung an alle Mitarbeiter und von den Anlageberatern an ihre identifizierten Mitarbeiter\* gezahlt:

|                         |               |
|-------------------------|---------------|
| Feste Vergütung         | USD 2.995.988 |
| Variable Vergütung      | USD 774.528   |
| Anzahl der Begünstigten | 30            |

Anteil davon, der auf die feste und variable Vergütung der Geschäftsleitung von HIFL und der identifizierten Mitarbeiter der Anlageberater entfiel:

|                         |               |
|-------------------------|---------------|
| Feste Vergütung         | USD 1.560.459 |
| Variable Vergütung      | USD 590.447   |
| Anzahl der Begünstigten | 15            |

\* Identifizierte Mitarbeiter sind definiert als Mitarbeiter, deren Tätigkeiten wesentliche Auswirkungen auf das Risikoprofil der Gesellschaft haben.

# Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

## Vergütungspolitik (Fortsetzung)

Die jährliche Überprüfung der Vergütungspolitik, einschließlich einer Überprüfung der bestehenden Vergütungsstruktur sowie der Umsetzung der Regulierungsanforderungen und deren Einhaltung, wurde während des Jahres durchgeführt und es wurden keine Unregelmäßigkeiten festgestellt. Des Weiteren wurden im vergangenen Geschäftsjahr keine wesentlichen Änderungen an der Vergütungspolitik vorgenommen.

## Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor („Offenlegungsverordnung“)

Die folgenden Teilfonds sind gemäß Artikel 6 SFDR per 31. März 2024 kategorisiert.

- Asia Bond
- Asia High Yield Bond
- Asian Currencies Bond
- Brazil Bond
- Euro Bond Total Return
- GEM Debt Total Return
- Global Emerging Markets Bond
- Global Emerging Markets Local Debt
- Global High Yield Bond
- US Short Duration High Yield Bond\*
- India Fixed Income
- RMB Fixed Income
- Singapore Dollar Income Bond
- US High Yield Bond
- BRIC Equity
- BRIC Markets Equity
- Frontier Markets
- Global Equity Volatility Focused
- Brazil Equity
- Economic Scale US Equity
- Indian Equity
- Mexico Equity (geschlossen zum 28. Juli 2023)
- Russia Equity\*\*
- Turkey Equity
- Global Credit Floating Rate Fixed Term Bond 2023 – 1 (geschlossen zum 5. Juli 2023)
- Global Credit Floating Rate Fixed Term Bond 2023 – 2 (geschlossen zum 29. Dezember 2023)
- Global Emerging Markets Multi-Asset Income
- Managed Solutions – Asia Focused Conservative
- Managed Solutions – Asia Focused Growth
- Managed Solutions – Asia Focused Income
- Multi-Asset Style Factors
- Multi-Strategy Target Return
- US Income Focused

\* Bis zum 2. Juli 2023 lautete der Name des Teilfonds „Global Short Duration High Yield Bond“.

\*\* Die Anlage in dem Teilfonds Russia Equity ist derzeit ausgesetzt.

# Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

## Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (Offenlegungsverordnung) (Fortsetzung)

Die folgenden Teilfonds sind gemäß Artikel 8 SFDR per 31. März 2024 kategorisiert.

- Asia ESG Bond
- Euro Bond
- Euro Credit Bond
- Euro High Yield Bond
- ESG Short Duration Credit Bond
- Global Bond
- Global Bond Total Return
- Global Corporate Bond
- Global Emerging Markets ESG Bond
- Global Emerging Markets ESG Local Debt
- Global ESG Corporate Bond
- Global Government Bond
- Global Green Bond
- Global High Income Bond
- Global High Yield ESG Bond
- Global High Yield Securitised Credit Bond
- Global Inflation Linked Bond
- Global Investment Grade Securitised Credit Bond
- Global Lower Carbon Bond
- Global Securitised Credit Bond
- Global Short Duration Bond
- Ultra Short Duration Bond
- US Dollar Bond
- Corporate Euro Bond Fixed Term 2027 (aufgelegt zum 30. Juni 2023)
- ASEAN Equity \*
- Asia ex Japan Equity
- Asia ex Japan Equity Smaller Companies
- Asia Pacific ex Japan Equity High Dividend
- China A-Shares Equity
- Chinese Equity
- Euroland Equity Smaller Companies
- Euroland Growth
- Euroland Value
- Europe Value
- Global Emerging Markets Equity
- Global Equity Climate Change
- Global Equity Sustainable Healthcare
- Global Infrastructure Equity
- Global Lower Carbon Equity
- Global Real Estate Equity
- Global Sustainable Equity Income
- Global Sustainable Long Term Dividend
- Hong Kong Equity

\* Bis zum 31. Juli 2023 lautete der Name des Teilfonds „Thai Equity“.

Die folgenden Teilfonds sind gemäß Artikel 9 SFDR per 31. März 2024 kategorisiert.

- Global Emerging Markets Corporate Sustainable Bond
- Global Equity Circular Economy
- Global Sustainable Long Term Equity

### Austritt des Vereinigten Königreichs aus der EU

Nach Ablauf der Übergangsfrist sind alle grenzüberschreitenden Passporting-Rechte bezüglich des Vereinigten Königreichs für EU-Fonds abgelaufen. Dank der Einführung eines Temporary Marketing Permissions Regime durch das Vereinigte Königreich können jedoch alle Fonds, die sich bei dem Regime registriert haben, weiterhin im Vereinigten Königreich vertrieben und von dort ansässigen Anlegern gekauft werden. Des Weiteren hat die britische Regierung nationale Gesetze zur Straffung des Verfehrens vorgelegt, um den Verkauf von Investmentfonds aus Übersee (einschließlich der EU) im Vereinigten Königreich nach dem Brexit zu ermöglichen.

Es wird zunehmend klar, dass es mehr Divergenzen zwischen britischen und EU-Verordnungen geben wird, die die grenzüberschreitenden Aktivitäten einschränken können. Zum Datum des Abschlusses sind die Teilfonds weiterhin von der FCA anerkannt und können britischen Anlegern angeboten werden. Aufsichtsrechtliche Änderungen werden vom Vereinigten Königreich nach dem Brexit weiterhin berücksichtigt. Die Art und das Ausmaß der Auswirkungen solcher Änderungen bleibt weiterhin ungewiss und kann beträchtlich sein.

# Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

## Auswirkungen von Pandemien

Pandemien können die globalen Märkte auf verschiedene Art und Weise beeinträchtigen, unter anderem durch: (i) die anhaltende Unsicherheit an den globalen Märkten, da nicht klar ist, wie lange eine Pandemie andauern wird, (ii) die Behinderung des regulären Geschäftsbetriebs in vielen verschiedenen Unternehmen, darunter Hersteller und Dienstleister, und (iii) die Verlangsamung oder Einstellung des internationalen, nationalen und lokalen Reiseverkehrs. Alle diese und weitere Faktoren wurden beispielsweise in den letzten Jahren bei dem weltweiten Ausbruch von COVID-19 beobachtet. Obwohl die Zahl der COVID-19-Fälle wieder zunimmt und das Risiko neuer Varianten besteht, haben sich die anfänglichen Auswirkungen auf die globalen Märkte in bestimmten Branchen langsam abgeschwächt. Die bisherigen finanziellen Auswirkungen des Ausbruchs und die Frage, ob eine neue Variante weitere Probleme mit sich bringen wird, lassen sich jedoch nicht zuverlässig abschätzen. Der Verwaltungsrat überwacht die Situation fortwährend und erhält regelmäßig aktualisierte Informationen von der Verwaltungsgesellschaft. Zum 31. März 2024 haben nach unserem Wissen die Auswirkungen von COVID-19 weder die Fähigkeit des Anlageverwalters beeinträchtigt, die Anlagestrategie der Teilfonds zu verfolgen, noch gab es Unterbrechungen bei den wichtigen, von der Gesellschaft bestellten Dienstleistern.

## Russlands Einmarsch in die Ukraine

Der Einmarsch Russlands in die Ukraine hatte schwerwiegende Auswirkungen auf die regionalen und globalen Wirtschaftsmärkte für Wertpapiere und Rohstoffe und könnten dies auch weiterhin haben. Als Reaktion auf das Vorgehen Russlands haben verschiedene Regierungen weitreichende Wirtschaftssanktionen gegen Russland erlassen, darunter:

- ein Verbot der Geschäftstätigkeit mit bestimmten russischen Unternehmen, großen Finanzinstituten, Beamten und Oligarchen;
- den Ausschluss ausgewählter russischer Banken aus der Society for Worldwide Interbank Financial Telecommunications („SWIFT“), dem elektronischen Banknetzwerk, das Banken weltweit verbindet, durch bestimmte Länder und die Europäische Union; und
- restriktive Maßnahmen, um zu verhindern, dass die russische Zentralbank die Auswirkungen der Sanktionen untergräbt.

Die aktuellen Ereignisse, einschließlich Sanktionen und potenzieller künftiger Sanktionen, insbesondere solcher, die den Energiesektor Russlands beeinflussen, und andere Maßnahmen sowie Russlands Vergeltungsmaßnahmen auf diese Sanktionen und Maßnahmen, könnten weiterhin negative Auswirkungen auf die Performance und Liquidität der globalen Märkte haben und damit den Wert der Anlagen der Teilfonds über ein direktes Engagement in russischen Emittenten hinaus negativ beeinflussen. Diese Ereignisse bergen außerdem erhebliche Unsicherheiten und Risiken in Bezug auf die globalen Märkte, und die Wertentwicklung der Teilfonds und ihre Anlagen oder Geschäftstätigkeit könnte beeinträchtigt werden. Anleger sollten sich darüber im Klaren sein, dass die Dauer der anhaltenden Kriegshandlungen und die Vielzahl von Sanktionen und die damit verbundenen Ereignisse nicht vorhersehbar sind.

## Auswirkungen der Ukraine-Russland-Krise

Der Verwaltungsrat hat beschlossen, den Teilfonds HGIF Russia Equity am 1. März 2022 bis auf Weiteres auszusetzen. Der Verwaltungsrat wird die Lage weiterhin überwachen. Jede spätere Entscheidung, die zu einer Änderung dieses Status führt, wird den Anlegern zu gegebener Zeit mitgeteilt.

Der Verwaltungsrat verfolgt in Zusammenarbeit mit der Verwaltungsgesellschaft die Lage weiterhin. Ab dem 2. März 2022 wurden alle auf RUB lautenden russischen Staatsanleihen und alle damit verbundenen Kupons, die im HGIF Global Emerging Markets Local Debt, im HGIF Global Emerging Markets ESG Local Debt und im HGIF Global Emerging Market Multi-Asset Income gehalten werden, auf 0 geschrieben.

Ab dem 3. März 2022 wurden alle russischen Aktien des HGIF Global Emerging Markets Multi Asset Income, des HGIF Global Equity Volatility Focused, des HGIF BRIC Markets Equity und des HGIF BRIC Equity um 90 % reduziert. Wenn bei ADR/GDR der Marktpreis um mehr als 90 % gefallen ist, wurde der Titel mit dem letzten Marktpreis bewertet. Ab dem 10. März 2022 wurden alle auf RUB lautenden russischen Aktien, die im HGIF Global Emerging Markets Multi Asset Income, im HGIF Global Equity Volatility Focused, im HGIF BRIC Markets Equity und im HGIF BRIC Equity gehalten werden, auf 0 geschrieben.

# Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

## Auswirkungen der Ukraine-Russland-Krise (Fortsetzung)

Das auf USD lautende und an der US-Börse notierte Wertpapier Yandex liegt seit dem 11. März 2022 bei 0. Dieses Wertpapier wird von HGIF BRIC Markets Equity und HGIF BRIC Equity gehalten. Die Wertpapiere von Sberbank PJSC ADR, Rosneft IIGDR und Severstal PJSC GDR wurden ab dem 2. Juni 2022 mit 0 bewertet. Diese Wertpapiere werden vom HGIF Russia Equity und vom HGIF BRIC Markets Equity gehalten.

Die Wertpapiere von Gazprom PJSC ADR, Lukoil PJSC und Novatek PJSC GDR wurden ab dem 1. Juli 2022 mit 0 bewertet. Diese Wertpapiere werden vom HGIF Russia Equity gehalten.

## Erklärung zur Unternehmensführung

Der Verwaltungsrat bestätigt, dass er dem Verhaltenskodex der ALFI (Vereinigung der Luxemburger Fondsbranche) folgt (der „Kodex“) und sich im Berichtszeitraum jederzeit nach den Grundsätzen dieses Kodex gerichtet hat.

## Jahreshauptversammlung

Die nächste Jahreshauptversammlung findet am Donnerstag, 26. September 2024 statt.

Die in diesem Bericht enthaltenen Informationen beziehen sich auf die Vergangenheit und sind nicht repräsentativ für zukünftige Ergebnisse.

# Bericht des Anlageberaters

**Marktbericht: 1. April 2023 bis zum 31. März 2024**

## **Globale Aktien**

Die weltweiten Aktien erzielten im Berichtszeitraum hohe Renditen, was in erster Linie auf die sinkende Inflation und die wachsende Überzeugung zurückzuführen war, dass die Zinssätze im Jahr 2024 sinken würden. Die Märkte wurden auch durch leicht verbesserte Konjunkturaussichten und starke Unternehmensgewinne beflügelt. Viele Märkte – darunter der MSCI World Index, der S&P 500, der Stoxx Euro 600 und der Nikkei 225 – erreichten neue Allzeithochs.

Zu Beginn des Berichtszeitraums waren die Märkte aufgrund zunehmender Ängste vor einem möglichen Zahlungsausfall der US-Regierung und der ungewissen Auswirkungen der Mini-Bankenkrise in den USA im März 2023, in deren Verlauf drei große regionale Banken zusammenbrachen, verunsichert. Die Schuldenobergrenze wurde jedoch letztendlich erhöht, was den Märkten Erleichterung brachte, die bis in den Frühsommer stiegen. Die Märkte erreichten Anfang August ihren Höhepunkt und gaben im September und Oktober nach, als sich die Anleger mit der Tatsache abfanden, dass die Zinssätze wahrscheinlich auf einem relativ hohen Niveau bleiben würden, und als der Ölpreis anstieg. In den letzten beiden Monaten des Jahres 2023 stiegen sie jedoch aufgrund erneuter Hoffnungen auf eine Zinssenkung deutlich an, und dieser Aufwärtstrend setzte sich im ersten Quartal 2024 fort. Dies geschah trotz einer gewissen Enttäuschung darüber, dass die Zentralbanken die geplanten Zinssenkungen in die zweite Hälfte des Jahres 2024 zu verschieben schienen, sowie ungeachtet der zunehmenden Sorgen über die Ereignisse im Nahen Osten und der wachsenden Spannungen, insbesondere im Gazastreifen.

Die Märkte der Industrieländer entwickelten sich deutlich besser als die Schwellenmärkte. Innerhalb der entwickelten Märkte lagen die USA an der Spitze und übertrafen die Indizes MSCI und FTSE World. Auch Japan verzeichnete eine starke Performance, insbesondere in Yen gerechnet. Kontinentaleuropa blieb hinter der globalen Durchschnittsrendite zurück, trotz erheblicher Stärke auf einigen Märkten, wie Italien und Dänemark. Das Vereinigte Königreich erzielte eine deutliche Underperformance. In Asien und den Schwellenländern schnitt China schlecht ab, während sich Indien und Taiwan stark zeigten. Auch die lateinamerikanischen Märkte entwickelten sich gut, wobei Argentinien der Spitzenreiter war.

Im Mittelpunkt standen die Geldpolitik der Zentralbanken und die Aussicht auf Zinssenkungen. Die Gesamtinflationen gingen in den meisten Ländern im Berichtszeitraum weiter zurück, während die Kerninflation (ohne die volatileren Energie- und Lebensmittelpreise) hartnäckiger blieb. Die US-Notenbank (Fed), die Bank of England (BoE) und die Europäische Zentralbank (EZB) beließen die Zinssätze im letzten Quartal 2023 und im ersten Quartal 2024 unverändert.

Das Wirtschaftswachstum war uneinheitlich. Die US-Wirtschaft erwies sich weiterhin als widerstandsfähig und verwirrte diejenigen, die eine Rezession oder zumindest eine deutliche Abkühlung erwartet hatten. Die Volkswirtschaften des Vereinigten Königreichs und der Eurozone entwickelten sich schleppender als erwartet, wobei das Vereinigte Königreich im letzten Quartal 2023 in eine technische Rezession fiel. In der Eurozone konnte eine Rezession knapp vermieden werden, da das Wachstum im letzten Quartal des Jahres unverändert blieb. Das Wachstum in Japan war schleppend, während Festlandchina im Jahr 2024 ein Wachstum von etwas mehr als 5 % erzielte und damit über dem Zielwert lag.

## **US-Aktien**

Die US-Aktien verzeichneten im Berichtszeitraum eine starke Performance und übertrafen andere weltweite Aktienmärkte in ihrer Gesamtheit. Die Performance wurde von der Überzeugung begünstigt, dass die Fed ihre geldpolitische Straffung abgeschlossen hat und 2024 mit Zinssenkungen beginnen wird, sowie von weitgehend besser als erwarteten Unternehmensergebnissen.

Der Berichtszeitraum begann mit Sorgen über die regionalen Banken des Landes, die einige aufsehenerregende Ausfälle erlebt hatten. Der Markt wurde im Mai von Sorgen verfolgt, dass es im Kongress keine Einigung über eine Anhebung der zulässigen Schuldenobergrenze der Regierung geben würde, was sich im September wiederholte. Diese Ängste wurden jedoch zerstreut, als Republikaner und Demokraten sich einigen konnten. Dies führte dazu, dass der Markt bis in den Hochsommer hinein einen Anstieg verzeichnete, bevor er sich wieder abschwächte, was vor allem auf die Befürchtung zurückzuführen war, dass die Zinssätze noch länger hoch bleiben müssten. Im November und Dezember erholte sich der Markt jedoch wieder stark, da die Anleger sinkende Zinssätze im Jahr 2024 einpreisten. Die Aktien setzten ihren Aufwärtstrend im Jahr 2024 fort, und die wichtigsten lokalen Aktienindizes – der S&P 500, der Dow Jones und der Nasdaq Composite – erreichten im ersten Quartal neue Allzeithochs. Technologiewerte legten während des gesamten Berichtszeitraums aufgrund hoher Gewinne und des Interesses an künstlicher Intelligenz kräftig zu. Sie wurden von den so genannten „Glorreichen Sieben“, Large-Cap-Titeln wie Microsoft, Nvidia und Apple angeführt. Im Januar überholte Microsoft Apple als weltweit größte Aktie (nach Marktkapitalisierung) und wurde die erste Aktie mit einer Marktkapitalisierung von über 3 Billionen US-Dollar.

Die Gesamtinflation ging weiter leicht zurück und fiel von 4,9 % im April 2023 auf 3,1 % im Januar 2024. Die Kerninflation ging ebenfalls zurück und sank von 5,5 % im April auf 3,8 % im Februar. Die Zentralbank beließ ihren Leitzins unverändert bei 5,5 % und damit auf einem 23-Jahres-Hoch (Stand Juli). Zum Jahreswechsel begannen die Entscheidungsträger der Fed, offen über Zinssenkungen im Jahr 2024 zu sprechen. Während sich die Hoffnungen auf eine Zinssenkung im ersten Quartal letztlich zerschlugen, gingen die Anleger nach wie vor davon aus, dass die Fed die Zinsen ab der Jahresmitte senken würde.

# Bericht des Anlageberaters (Fortsetzung)

## US-Aktien (Fortsetzung)

Das US-Wirtschaftswachstum blieb relativ robust. Das annualisierte BIP stieg im dritten Quartal 2023 um 4,9 % und im letzten Quartal des Jahres um 3,4 %. Für das Gesamtjahr 2023 wuchs die Wirtschaft um 2,5 % – ein Anstieg von 1,9 % gegenüber dem Wirtschaftswachstum im Jahr 2022. Trotz eines leichten Anstiegs der Arbeitslosenzahlen blieb die Arbeitslosenquote unter 4 % der Erwerbstätigen. Die Schaffung von Arbeitsplätzen, insbesondere die Zahl der Beschäftigten außerhalb der Landwirtschaft, übertraf im Allgemeinen die Prognosen, während die Erstanträge auf Arbeitslosenhilfe Anfang Januar auf den niedrigsten Stand seit einem Jahr fielen. Die Zahl der offenen Stellen ging jedoch während des Berichtszeitraums allmählich zurück.

Die Sorgen über zunehmende Spannungen im Nahen Osten und in der Ukraine sowie über die Beziehungen zu Festlandchina konnten die positive Stimmung an den US-Aktienmärkten letztlich nicht trüben.

## Europäische Aktien (ohne GB)

Die kontinentaleuropäischen Aktien erzielten positive Renditen, blieben aber insgesamt hinter den anderen globalen Märkten zurück. Während Europa von den positiven Inflationstendenzen und der wachsenden Erwartung sinkender Zinsen profitierte, hielten die wirtschaftliche Stagnation und die realen Aussichten auf eine Rezession die europäischen Aktien relativ gesehen zurück.

Der Berichtszeitraum begann nach einer Mini-Bankenkrise, die sich zwar hauptsächlich auf die USA konzentrierte, aber auch dazu führte, dass Credit Suisse praktisch insolvent wurde und von der UBS gerettet werden musste. Im Mai gaben die Aktienmärkte zusammen mit anderen globalen Märkten erneut nach, da die Sorge wuchs, ob die USA ihre Schuldenobergrenze rechtzeitig anheben würden, um einen technischen Zahlungsausfall zu vermeiden, was schließlich auch gelang. Sie erreichten Ende Juli ihren Höchststand und fielen in den Spätsommer- und Frühherbstmonaten aufgrund steigender Öl- und Erdgaspreise, wachsender geopolitischer Bedenken, schwacher Wirtschaftsdaten und weitgehend restriktiver Signale der EZB. In den letzten beiden Monaten des Jahres 2023 erholten sich die Märkte jedoch deutlich, da sich die Anzeichen verdichteten, dass die Zinssätze im Jahr 2024 sinken würden. Diese positive Dynamik setzte sich bis ins Jahr 2024 fort, auch wenn eine gewisse Enttäuschung darüber herrschte, dass die Zinssenkungen wahrscheinlich in die zweite Jahreshälfte verschoben würden. Das positive Wachstum der Unternehmensgewinne beflügelte jedoch die Stimmung, und sowohl der Dax in Deutschland als auch der europaweite Stoxx Europe 600 Index erreichten im ersten Quartal 2024 neue Allzeithochs.

Die Gesamtinflation in der Eurozone ging weiter zurück. Sie fiel von 7,0 % im April 2023 auf 2,4 % im November – den niedrigsten Stand seit über zwei Jahren – und beendete den Berichtszeitraum im Februar bei 2,6 %. Die Kerninflation blieb im Februar höher, auf 3,1 %, und lag damit immer noch weit über dem mittelfristigen Ziel der EZB von 2 %.

Die Zentralbank hob ihren Leitzins bis Mitte 2023 viermal an, und zwar von 3,5 % auf 4,5 %, den höchsten Stand seit 22 Jahren. Die EZB-Vorsitzende Christine Lagarde warnte über weite Strecken des Jahres, dass der Kampf gegen die Inflation weitergehen würde, wobei sie im September andeutete, dass es möglich sei, dass die Zinserhöhungen abgeschlossen seien, und anschließend gab es auch keine weiteren Zinserhöhungen. Ende des Jahres gab es weit verbreitete Spekulationen, dass die Zinsen 2024 gesenkt werden würden.

Das Wirtschaftswachstum blieb schleppend. Im Jahr 2023 wuchs es kaum noch und eine Rezession blieb eine Bedrohung. Im dritten Quartal fiel das BIP um 0,1 %, eine Rezession wurde jedoch vermieden, da das BIP im letzten Quartal 2023 unverändert blieb. Die Ausgaben der privaten Haushalte in der gesamten Eurozone waren gedämpft, da die Verbraucher weiterhin über die Inflation und die schwachen Wirtschaftsaussichten besorgt waren. Auch die Einkaufsmanagerindizes verschlechterten sich im Berichtszeitraum, wobei der zusammengesetzte Wert für das verarbeitende Gewerbe und den Dienstleistungssektor ab Juni in den kontraktiven Bereich (unter 50,0) fiel und dort bis Februar verharrte, obwohl es Anfang 2024 Anzeichen für eine Verbesserung gab. Der Arbeitsmarkt blieb jedoch relativ robust, und die Arbeitslosenquote in der Eurozone sank im Februar auf ein Allzeittief von 6,5 %.

## UK-Aktien

Die britischen Aktien legten während des Berichtszeitraums leicht zu, blieben jedoch deutlich hinter den anderen entwickelten Märkten zurück, da Sorgen über die wirtschaftlichen Aussichten und politische Unsicherheiten die Stimmung der Anleger dämpften.

Anfang April stiegen die Aktienkurse, da die Anleger erleichtert waren, dass sich die Mini-Bankenkrise (bei der drei US-Regionalbanken und die Credit Suisse zusammenbrachen) nicht zu einer größeren Finanzkrise ausgeweitet hatte. Danach erholte sich der Markt gelegentlich, als die Hoffnung aufkam, dass die Zinssätze sich dem Höchststand nähern und die britische Wirtschaft eine Rezession noch abwenden könnte. Im Frühherbst verzeichnete er einen Rückgang, da sich die Lage im Nahen Osten verschlechterte und die steigenden Ölpreise erneut Befürchtungen aufkommen ließen, dass die Inflation auf einem relativ hohen Niveau verharrern könnte. In den letzten Monaten des Jahres 2023 und zu Beginn des Jahres 2024 erholte sich der Markt aber, da die Anleger in Bezug auf Zinssenkungen im Jahr 2024 optimistisch waren, er blieb aber insgesamt weiterhin hinter anderen globalen Märkten zurück. Die Zusammensetzung des britischen Index war angesichts seines kleinen Technologiesektors und seines relativ hohen Engagements in rohstoffbezogenen Titeln, die im ersten Quartal 2024 insgesamt nicht gut abschnitten, nicht hilfreich.

# Bericht des Anlageberaters (Fortsetzung)

## UK-Aktien (Fortsetzung)

Während die Gesamtinflation im Vereinigten Königreich zurückging, blieb sie in der ersten Hälfte des Berichtszeitraums zunächst höher als in vielen anderen Industrieländern. Der Rückgang der Inflation beschleunigte sich jedoch allmählich, da die Lebensmittel- und Energiepreise sowie die Lohninflation ihren Höhepunkt erreichten. Sie sank von 8,7 % im April auf 3,4 % im Februar. Die Kerninflation blieb höher. Nachdem sie im Mai ein neues 31-Jahres-Hoch von 7,1 % erreicht hatte, fiel sie im Februar auf 4,5 % zurück.

Die BoE hob die Zinssätze von 4,25 % zu Beginn des Berichtszeitraums auf ein 15-Jahres-Hoch von 5,25 % Anfang August an. Nach 14 Zinsanhebungen in Folge, die bis Ende 2021 zurückreichen, beließ die BoE die Zinssätze auf ihrer Sitzung im September und den weiteren Sitzungen des Policy Committee im Berichtszeitraum unverändert. Andrew Bailey, Gouverneur der BoE, blieb jedoch vorsichtig, die Zinssätze zu früh zu senken. Dies stoppte aber nicht die Spekulationen, dass die BoE ihre Zinssätze im Jahr 2024 senken müsse, da die Wirtschaftsaussichten weiterhin schwach waren.

Die Wirtschaft rutschte im letzten Quartal 2023 in eine Rezession. Das BIP sank auf Quartalsbasis um 0,3 %, nachdem es im dritten Quartal bereits um 0,1 % gefallen war. Die Lebenshaltungskostenkrise und die erhöhte Steuerlast – die Steuern im Vereinigten Königreich lagen auf dem höchsten Stand seit 70 Jahren – unterminierten die Verbraucherausgaben, das Fundament der britischen Wirtschaft und waren treibende Kraft für den Rückgang des Wirtschaftswachstums. Es herrschte jedoch ein gewisser Optimismus, dass sich die Rezession als kurzlebig erweisen würde, insbesondere da die monatlichen BIP-Daten für Januar und Februar auf eine Erholung des Wachstums hindeuteten. Der Arbeitsmarkt blieb relativ robust, die Zahl der Erwerbstätigen lag auf hohem Niveau, und die Arbeitslosenquote blieb mit 4,0 % in den drei Monaten bis Januar relativ niedrig.

## Japanische Aktien

Die japanischen Aktien verzeichneten im Berichtszeitraum eine starke Performance und übertrafen andere globale Märkte in ihrer Gesamtheit. Sie erzielten in Yen ausgedrückt hervorragende Renditen, obwohl die Renditen in US-Dollar und Pfund Sterling aufgrund der Schwäche des Yen niedriger ausfielen. Der Leitindex Nikkei 225 erreichte im Februar erstmals seit über 34 Jahren ein neues Allzeithoch und stieg schließlich im März auf über 40.000 Punkte. Dies war insbesondere auf den wachsenden Optimismus zurückzuführen, dass die japanische Wirtschaft im Begriff war, ihrer jahrzehntelangen Deflation zu entfliehen, sowie auf ein beeindruckendes Gewinnwachstum – nicht zuletzt in Japans großem Exportsektor, der vom schwächeren Yen profitierte. Der Markt erholte sich ebenso wie andere Weltmärkte, da man erwartete, dass die globalen Zinssätze sinken und zu einer Wiederbelebung der Weltwirtschaft führen würden. Auf der negativen Seite wirkten sich die sich verschlechternde Lage im Nahen Osten, steigende Ölpreise und blasse Wirtschaftsdaten im Verlauf des Jahres negativ auf die Stimmung der Anleger aus.

Die Aufmerksamkeit der Anleger richtete sich zunehmend auf die geldpolitischen Absichten der Bank of Japan (BoJ), insbesondere auf eine mögliche Änderung ihrer seit langem bestehenden ultralockeren Geldpolitik. Die Zentralbank lockerte 2023 ihre Politik zur Steuerung der Renditekurve leicht und ließ zu, dass die Renditen 10-jähriger Staatsanleihen nach oben drifteten. Die BoJ schien zunächst entschlossen, einer Änderung ihrer insgesamt lockeren Politik zu widerstehen. Allerdings räumte der BoJ-Gouverneur Kazuo Ueda im Herbst ein, dass der wachsende Lohndruck in der Wirtschaft die Zentralbank zu einer Änderung ihres Kurses zwingen könnte, falls er anhält. Schließlich hob die BoJ im März 2024 die Zinsen zum ersten Mal seit 17 Jahren an und erhöhte den kurzfristigen Zinssatz von -0,1 % auf eine Spanne von 0,0 % bis 0,1 %.

Die jährliche Verbraucherinflation ging während des Berichtszeitraums zurück und sank von 3,5 % im April 2023 auf 2,2 % im Januar, obwohl sie im Februar wieder auf 2,8 % gestiegen war. Die BoJ war weiterhin besorgt, dass die Inflation nicht dauerhaft auf ihr Zielniveau von 2 % fallen würde, insbesondere vor dem Hintergrund des zunehmenden Lohndrucks, der durch die größten Lohnabschlüsse seit Jahrzehnten in der gesamten Wirtschaft ausgelöst wurde.

Die japanische Wirtschaft blieb trotz einiger vereinzelter Anzeichen einer Erholung fragil. Vorläufige BIP-Zahlen für das vierte Quartal deuteten darauf hin, dass Japan wieder in die Rezession zurückgefallen war, denn auf einen Rückgang von 0,8 % im dritten Quartal 2023 folgte ein Rückgang von 0,1 % im vierten Quartal. Allerdings wurde der Wert für das vierte Quartal Anfang März auf einen Anstieg von 0,1 % korrigiert.

Der Yen schwächte sich gegenüber dem US-Dollar deutlich ab und fiel im Berichtszeitraum von etwa 132 auf etwa 151 – den niedrigsten Stand seit Anfang der 1990er Jahre. Dies geschah trotz der drohenden Intervention durch die japanischen Behörden. Obwohl der Yen nach der Zinsanhebung durch die BoJ kurzzeitig zulegte, setzte sich die Schwäche der Währung im weiteren Verlauf des Monats März fort.

## Asiatische Aktien (ohne Japan)

Die Aktien aus Asien ohne Japan erzielten leicht positive Renditen, sie blieben jedoch deutlich hinter der Gesamtrendite der globalen Aktienmärkte zurück. Obwohl die Inflationsraten in der gesamten Region zurückgingen, sorgten sich die Anleger über die Auswirkungen höherer Zinssätze auf die wirtschaftliche Nachfrage sowie über den stärkeren US-Dollar, steigende Ölpreise und geopolitische Spannungen – insbesondere die Beziehungen zwischen den USA und Festlandchina.



# Bericht des Anlageberaters (Fortsetzung)

## Asiatische Aktien (ohne Japan) (Fortsetzung)

Das Wirtschaftswachstum in Festlandchina enttäuschte die Anleger, da es nach einer anfänglichen Aufschwung nach der Aufhebung der COVID-19-bedingten Beschränkungen Ende 2022 zu schwächeln schien. Die asiatischen Märkte erholten sich in den Sommermonaten ein wenig, da die Hoffnung zunahm, dass die Fed kurz vor dem Ende ihres geldpolitischen Straffungszyklus stand. Die eher restriktiven Kommentare der Fed und anderer großer Zentralbanken zur Wahrscheinlichkeit, dass die Zinsen länger hoch bleiben würden, zogen die Märkte im Herbst nach unten, bevor sie sich in den letzten beiden Monaten des Jahres und im ersten Quartal 2024 zusammen mit anderen globalen Märkten erholten.

Festlandchina war einer der schwächsten Hauptmärkte in der Region, insbesondere in Lokalwährung. Hongkong verzeichnete ebenfalls einen Rückgang, da die Wirtschaft zu kämpfen hatte, während Thailand aufgrund von Sorgen über die politische Unsicherheit im Land, des Kursverfalls des Baht und enttäuschender Unternehmensgewinne schwächer tendierte. Demgegenüber verzeichnete Indien dank eines robusten Wirtschaftswachstums eine starke Performance und der lokale Sensex-Index erreichte ein neues Allzeithoch. Südkorea und insbesondere Taiwan erzielten ebenfalls hohe Renditen, da sie von einem positiven Technologiezyklus und einer positiven Produktnachfrage profitierten.

Die Zentralbanken in der Region nahmen die geldpolitische Straffung zurück. Die Zentralbanken in Indien und Südkorea ließen die Zinssätze unverändert, während die People's Bank of China die Zinssätze leicht senkte und für reichlich Liquidität auf den Geldmärkten sorgte, um das Wirtschaftswachstum anzukurbeln. Die Gesamtinflation war allgemein rückläufig und in Festlandchina sank die jährliche Verbraucherinflation im Januar auf -0,8 % – den niedrigsten Stand seit fast 15 Jahren –, bevor sie im Februar wieder in den positiven Bereich stieg. In Indien trieb die drastische Lebensmittelinflation die Gesamtinflation im Juli auf 7,4 %, bevor sie im Februar wieder auf 5,1 % zurückging.

Festlandchina erzielte in den letzten beiden Quartalen 2023 ein Wachstum von etwas mehr als 5 % und erreichte damit sein Ziel für 2023, im Gesamtjahr 2023 um mindestens 5 % zu wachsen. Indiens Wirtschaft war relativ stark und wuchs im zweiten, dritten und vierten Quartal des Jahres um mehr als 8 %, da die Verbraucherausgaben anzogen und der Dienstleistungsbereich der Wirtschaft stark war. Insgesamt blieb das Wirtschaftswachstum in der Region Asien ohne Japan jedoch relativ gedämpft.

## Schwellenmarktaktien

Die Schwellenmärkte erwirtschafteten während des Berichtszeitraums positive Renditen, wobei fast die gesamte positive Performance in der zweiten Jahreshälfte erzielt wurde. Sie blieben jedoch deutlich hinter den Märkten der Industrieländer zurück. Obwohl die Inflationsraten in der gesamten Region allgemein zurückgingen, sorgten sich die Anleger über die Auswirkungen höherer Zinssätze auf die wirtschaftliche Nachfrage sowie über den stärkeren US-Dollar, steigende Ölpreise und geopolitische Spannungen – insbesondere die Beziehungen zwischen den USA und Festlandchina. Das Wirtschaftswachstum in Festlandchina enttäuschte die Anleger, da es nach einer anfänglichen Aufschwung nach der Aufhebung der COVID-19-bedingten Beschränkungen Ende 2022 zu schwächeln schien.

Die Schwellenmärkte erholten sich in den Sommermonaten, da die Hoffnung zunahm, dass die Fed kurz vor dem Ende ihres geldpolitischen Straffungszyklus stand. Allerdings wurden die Märkte im Herbst durch die eher restriktiven Kommentare der Fed und anderer großer Zentralbanken zur Wahrscheinlichkeit, dass die Zinsen länger hoch bleiben würden, nach unten gezogen, bevor die Jahresendrallye einsetzte, die von der Hoffnung auf sinkende Zinssätze angetrieben wurde. Diese Rally setzte sich bis ins erste Quartal 2024 fort.

Während die asiatischen Schwellenmärkte die Performance belasteten, erzielten lateinamerikanische Aktien eine starke Outperformance. Trotz drastischer dreistelliger Inflation und extrem hoher Zinssätze war Argentinien der Markt mit der besten Performance. Dies war zum Teil auf Hoffnungen auf radikale Reformen zurückzuführen, die sich auf den neuen Präsidenten Javier Milei stützten, der Ende des Jahres gewählt wurde. Brasilien erzielte ebenfalls positive Renditen, da die Zentralbank ab dem Spätsommer 2023 die Zinssätze sechsmal von 13,75 % auf 10,75 % senkte und sich die Wirtschaft erholte. Auch die europäischen Schwellenmärkte legten kräftig zu, wobei sowohl Ungarn als auch Polen besonders gut abschnitten. In den Schwellenländern verlangsamte sich die Inflation im Allgemeinen, so dass einige Zentralbanken – insbesondere die Banken in Brasilien, Chile und Peru – Zinssenkungen durchführen konnten. Auch Festlandchina senkte die Zinssätze leicht, um seine Wirtschaft und den angeschlagenen Immobiliensektor zu stützen.

# Bericht des Anlageberaters (Fortsetzung)

## Schwellenmarktaktien (Fortsetzung)

In Bezug auf das Wirtschaftswachstum erzielte Festlandchina in den letzten beiden Quartalen 2023 ein Wachstum von etwas mehr als 5 % und erreichte damit sein Ziel für 2023, im Gesamtjahr 2023 um mindestens 5 % zu wachsen. Indiens Wirtschaft war relativ stark und wuchs im zweiten, dritten und vierten Quartal des Jahres um mehr als 8 %, da die Verbraucherausgaben anzogen und der Dienstleistungsbereich der Wirtschaft stark war. Insgesamt blieb das Wirtschaftswachstum in der Region Asien ohne Japan jedoch relativ gedämpft. Das brasilianische Wirtschaftswachstum war gedämpfter, mit einem BIP-Anstieg von 2,0 % bzw. 2,1 % auf Jahresbasis im dritten bzw. vierten Quartal 2023, wobei sich die Landwirtschaft gut erholte. Die mexikanische Wirtschaft verlangsamte sich gegen Ende des Jahres 2023 ein wenig und erreichte ein jährliches Wachstum von 3,5 % im dritten Quartal und 2,5 % im vierten Quartal. Damit war jedoch sichergestellt, dass die Wirtschaft 11 Quartale in Folge ein jährliches Wachstum verzeichnete.

## Britische Anleihen

Der britische Anleihemarkt verzeichnete im Berichtszeitraum einen leichten Rückgang. Im Gegensatz dazu erzielten nichtstaatliche oder Unternehmensanleihen eine positive Rendite, da die Anleger insbesondere in der zweiten Hälfte des Berichtszeitraums eine höhere Risikobereitschaft zeigten.

Die Anleiherenditen stiegen in den Frühjahrs- und Frühsommermonaten. Ab dem Spätsommer sanken die Renditen jedoch, da die BoE keine weiteren Zinsanhebungen durchführte und die Gesamtinflation noch stärker zurückging. Die beste Performance kam in den letzten beiden Monaten des Jahres zustande - einem der besten kurzfristigen Zeiträume für Gilts seit Jahrzehnten -, als die Anleihen aufgrund der wachsenden Überzeugung, dass die Zinssätze im Jahr 2024 sinken würden, stark anzogen. Die Rendite der 10-jährigen Anleihen ging im November und Dezember um ca. 100 Basispunkte (Bp.) zurück. Im ersten Quartal 2024 stiegen die Renditen jedoch wieder an, da die BoE – und auch andere wichtige Zentralbanken wie die Fed und die EZB – darauf hinwiesen, dass die Inflation noch nicht ausreichend eingedämmt sei und die Zinsen wahrscheinlich noch länger hoch bleiben würden.

Während des Berichtszeitraums stieg die Rendite der als Benchmark verwendeten 10-jährigen Anleihe von etwa 3,5 % auf etwa 4,0 %, nachdem sie im Spätsommer einen Höchststand von 4,8 % erreicht hatte. Die Renditen kurzfristiger Anleihen stiegen weiter an. Die Rendite der zweijährigen Gilts stieg um etwa 70 Bp. von 3,5 % auf 4,2 %.

Während die Gesamtinflation im Vereinigten Königreich zurückging, blieb sie in der ersten Hälfte des Berichtszeitraums zunächst höher als in vielen anderen Industrieländern. Der Rückgang der Inflation beschleunigte sich jedoch allmählich, da die Lebensmittel- und Energiepreise sowie die Lohninflation ihren Höhepunkt erreichten. Sie sank von 8,7 % im April auf 3,4 % im Februar. Die Kerninflation blieb höher. Nachdem sie im Mai ein neues 31-Jahres-Hoch von 7,1 % erreicht hatte, fiel sie im Februar auf 4,5 % zurück.

Die BoE hob die Zinssätze von 4,25 % zu Beginn des Berichtszeitraums auf ein 15-Jahres-Hoch von 5,25 % Anfang August an. Nach 14 Zinsanhebungen in Folge, die bis Ende 2021 zurückreichen, beließ die BoE die Zinssätze auf ihrer Sitzung im September und den weiteren Sitzungen des Policy Committee im Berichtszeitraum unverändert. Andrew Bailey, Gouverneur der BoE, blieb jedoch vorsichtig, die Zinssätze zu früh zu senken. Dies stoppte aber nicht die Spekulationen, dass die BoE ihre Zinssätze im Jahr 2024 senken müsse, da die Wirtschaftsaussichten weiterhin schwach waren.

Die Wirtschaft rutschte im letzten Quartal 2023 in eine Rezession. Das BIP sank auf Quartalsbasis um 0,3 %, nachdem es im dritten Quartal bereits um 0,1 % gefallen war. Die Lebenshaltungskostenkrise und die erhöhte Steuerlast – die Steuern im Vereinigten Königreich lagen auf dem höchsten Stand seit 70 Jahren – unterminierten die Verbraucherausgaben, das Fundament der britischen Wirtschaft und waren treibende Kraft für den Rückgang des Wirtschaftswachstums. Es herrschte jedoch ein gewisser Optimismus, dass sich die Rezession als kurzlebig erweisen würde, insbesondere da die monatlichen BIP-Daten für Januar und Februar auf eine Erholung des Wachstums hindeuteten. Der Arbeitsmarkt blieb relativ robust, die Zahl der Erwerbstätigen lag auf hohem Niveau, und die Arbeitslosenquote blieb mit 4,0 % in den drei Monaten bis Januar relativ niedrig.

## Globale Anleihen

Während Unternehmensanleihen positive Renditen erzielten (insbesondere High-Yield- und Schwellenmarktanleihen, da sich die Spreads gegenüber Staatsanleihen verengten), gaben Staatsanleihen in Pfund Sterling gemessen im Berichtszeitraum nach. Ein Großteil der Schwäche entfiel auf japanische Staatsanleihen. US-Staatsanleihen waren ebenfalls schwächer, während deutsche und britische Anleihen nur leicht negative Renditen verzeichneten. Die überdurchschnittliche Performance der globalen Unternehmensanleihemärkte spiegelt die höheren relativen Renditen und die größere Risikobereitschaft der Anleger wider.

# Bericht des Anlageberaters (Fortsetzung)

## Globale Anleihen (Fortsetzung)

Der Markt war geprägt von einer stetig sinkenden Inflation, einer Verlangsamung des Tempos der Zinserhöhungen zu Beginn des Berichtszeitraums und schließlich einem Stopp der Zinserhöhungen durch die großen Zentralbanken im letzten Quartal des Jahres. Die letzten beiden Monate des Jahres 2023 waren einer der besten kurzfristigen Zeiträume für Staatsanleihen seit Jahrzehnten -, als die Anleihen aufgrund der wachsenden Überzeugung, dass die Zinssätze im Jahr 2024 sinken würden, stark anzogen. Die Anleiherenditen legten im ersten Quartal 2024 wieder zu, als klar wurde, dass die Fed, die EZB und die BoE es nicht eilig hatten, Zinssenkungen durchzuführen und abwarten würden, bis die Inflation ausreichend auf die Zielniveau fiel. Ende März preisten Anleger und Händler eine Zinssenkung irgendwann in der zweiten Jahreshälfte 2024 ein.

Die Gesamtinflationen gingen in den meisten Ländern weiter zurück. In den USA fiel sie von 4,9 % im April 2023 auf 3,1 % im Januar. In der Eurozone sank sie von 7,0 % im April 2023 auf 2,4 % im November – der niedrigste Stand seit über zwei Jahren – und beendete den Berichtszeitraum im Februar mit 2,6 %. Im Vereinigten Königreich beschleunigte sich der Inflationsrückgang in den Sommermonaten allmählich, da die Lebensmittel- und Energiepreise sowie die Lohninflation ihren Höhepunkt erreichten. Sie sank von 8,7 % im April auf 3,4 % im Februar.

In den ersten Monaten des Berichtszeitraums setzten die großen Zentralbanken ihre Zinserhöhungen fort, verlangsamten jedoch ihr Tempo. Im letzten Quartal 2023 beließen sie die Zinssätze jedoch unverändert, und Ende 2023 spekulierten die meisten Anleger darauf, dass es den Zentralbanken bald möglich sein würde, die Zinssätze im Jahr 2024 zu senken.

Das Wirtschaftswachstum war uneinheitlich. Die US-Wirtschaft erwies sich weiterhin als widerstandsfähig und verwirrte diejenigen, die eine Rezession oder zumindest eine deutliche Abkühlung erwartet hatten. Die Beschäftigungstrends in den USA waren weiterhin positiv, obwohl die Schaffung von Arbeitsplätzen Anzeichen einer Abschwächung zeigte. Die Volkswirtschaften des Vereinigten Königreichs und der Eurozone entwickelten sich schleppender als erwartet, wobei das Vereinigte Königreich im letzten Quartal 2023 in eine technische Rezession fiel, nachdem das BIP in zwei aufeinanderfolgenden Quartalen gesunken war. In der Eurozone konnte eine Rezession knapp vermieden werden, da das Wachstum im letzten Quartal des Jahres unverändert blieb. In Japan war das Wachstum schleppend. Festlandchina erzielte 2024 ein Wachstum von 5,2 % und lag damit knapp über dem Zielwert, stand aber weiterhin vor erheblichen Herausforderungen im Immobiliensektor und in der Kommunalverwaltung, wo erhebliche Schuldenprobleme anhielten.

An die Anteilinhaber von  
**HSBC Global Investment Funds**

---

### **Bestätigungsvermerk**

Nach unserer Auffassung vermittelt der beigefügte Jahresabschluss ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Vermögens- und Finanzlage von HSBC Global Investment Funds und ihrer jeweiligen Teilfonds (der „Fonds“) zum 31. März 2024 sowie der Ertragslage und der Entwicklung des Fondsvermögens für das am selben Tag endende Geschäftsjahr und hält sich dabei an die in Luxemburg maßgeblichen gesetzlichen und aufsichtsbehördlichen Regelungen für die Erstellung und Präsentation eines Jahresabschlusses.

#### *Was von uns geprüft wurde*

Der Abschluss des Fonds umfasst:

- die Nettovermögensaufstellung zum 31. März 2024;
- die Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024;
- die Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das an diesem Datum abgelaufene Geschäftsjahr; und
- die Erläuterungen zum Abschluss, die eine Zusammenfassung der wesentlichen Bilanzierungsgrundsätze enthalten.

---

### **Grundlage für den Bestätigungsvermerk**

Wir führten unsere Abschlussprüfung gemäß dem Gesetz vom 23. Juli 2016 über den Beruf des Abschlussprüfers (Gesetz vom 23. Juli 2016) und den in Luxemburg von der „Commission de Surveillance du Secteur Financier“ (CSSF) umgesetzten Internationalen Abschlussprüfungsgrundsätzen (ISAs) durch. Unsere Pflichten gemäß dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und den in Luxemburg von der CSSF umgesetzten ISAs sind im Abschnitt „Pflichten des „Réviseur d’entreprises agréé“ in Bezug auf die Prüfung des Abschlusses“ in unserem Bericht näher beschrieben.

Wir sind der Auffassung, dass die von uns eingeholten Prüfungsnachweise ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unseren Bestätigungsvermerk zu dienen.

Wir sind gemäß dem vom internationalen Rat für die Verabschiedung von Standards zur Berufsethik für Wirtschaftsprüfer (International Ethics Standards Board for Accountants, IESBA) herausgegebenen Kodex der ethischen Grundsätze für den Berufsstand (Code of Ethics for Professional Accountants – IESBA Code) in der von der CSSF in Luxemburg umgesetzten Form sowie den für unsere Prüfung des Abschlusses relevanten ethischen Anforderungen von dem Fonds unabhängig. Wir sind unserer sonstigen ethischen Verantwortung gemäß diesen ethischen Anforderungen gerecht geworden.

---

### **Sonstige Informationen**

Der Verwaltungsrat des Fonds ist für die sonstigen Informationen verantwortlich. Die sonstigen Informationen umfassen die im Jahresbericht genannten Informationen, jedoch nicht den Abschluss und unseren darin enthaltenen Bestätigungsvermerk.

Unsere Meinung zum Abschluss bezieht sich nicht auf die sonstigen Informationen und wir drücken keinerlei Art von Prüfungsurteil hinsichtlich der Zuverlässigkeit der sonstigen Informationen aus.

*PricewaterhouseCoopers, Société coopérative, 2, rue Gerhard Mercator, B.P. 1443, L-1014 Luxembourg  
T: +352 494848 1, F: +352 494848 2900, www.pwc.lu*

*Cabinet de révision agréé Wirtschaftsprüfer (staatliche Zulassung Nr. 10028256)  
Luxemburger Handels- und Firmenregister Luxemburg B 65 477 – TVA LU25482518*

In Verbindung mit unserer Prüfung des Abschlusses sind wir dafür verantwortlich, die sonstigen vorstehend genannten Informationen zu lesen und dabei zu beurteilen, ob die sonstigen Informationen wesentlich im Widerspruch zum Abschluss oder zu unserem bei der Abschlussprüfung erlangten Wissen stehen oder anderweitig wesentlich falsch dargestellt erscheinen. Wenn wir aufgrund der von uns durchgeführten Tätigkeiten zu dem Schluss kommen, dass eine wesentliche falsche Darstellung dieser sonstigen Informationen vorliegt, müssen wir über diese Tatsache berichten. Wir haben diesbezüglich nichts zu berichten.

---

#### **Verantwortung des Verwaltungsrats des Fonds für den Jahresabschluss**

Der Verwaltungsrat des Fonds ist für die Erstellung und ehrliche Darstellung des Abschlusses gemäß den gesetzlichen und aufsichtsrechtlichen Bestimmungen Luxemburgs für die Erstellung und Darstellung von Abschlüssen und für entsprechende interne Kontrollmaßnahmen verantwortlich, die der Verwaltungsrat des Fonds für die Erstellung von Abschlüssen für notwendig erachtet, die frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern sind.

Bei der Erstellung des Abschlusses ist der Verwaltungsrat des Fonds verantwortlich für die Beurteilung der Fähigkeit des Fonds zur Fortsetzung des Geschäftsbetriebs. Dabei muss er Angelegenheiten, die sich auf die Fortsetzung des Geschäftsbetriebs und die Verwendung des Grundsatzes der Unternehmensfortführung beziehen, gegebenenfalls offenlegen, es sei denn, der Verwaltungsrat des Fonds hat die Absicht, den Fonds zu liquidieren oder die Geschäftstätigkeit einzustellen, bzw. hat keine realistische Alternative zu diesem Vorgehen.

---

#### **Pflichten des „Réviseur d'entreprises agréé“ in Bezug auf die Prüfung des Abschlusses**

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

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

- die Identifizierung und Beurteilung der Risiken wesentlicher falscher Darstellungen im Abschluss aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern, die Planung und Durchführung von Prüfungshandlungen als Reaktion auf diese Risiken und die Erlangung von Prüfungsnachweisen, die als Grundlage für die Erteilung unseres Bestätigungsvermerks ausreichend und angemessen sind. Das Risiko, dass wesentliche falsche Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen nicht entdeckt werden, ist höher als bei wesentlichen falschen Darstellungen, die aus Irrtümern resultieren, da dolose Handlungen geheime Absprachen, Fälschungen, gezielte Auslassungen, falsche Angaben wesentlicher Umstände oder die Umgehung interner Kontrollen beinhalten können;
- Erlangung eines Verständnisses der für die Abschlussprüfung relevanten internen Kontrollen, um den Umständen angemessene Prüfungsverfahren zu erarbeiten, jedoch nicht, um eine Meinung über die Wirksamkeit der internen Kontrollen des Fonds abzugeben;
- Beurteilung der Angemessenheit der angewandten Rechnungslegungsgrundsätze und der vom Verwaltungsrat des Fonds vorgenommenen Schätzungen und der damit im Zusammenhang stehenden Offenlegungen;



- Schlussfolgerung, ob der vom Verwaltungsrat des Fonds bei der Erstellung des Abschlusses angewandte Grundsatz der Unternehmensfortführung angemessen ist und ob auf der Grundlage der erlangten Prüfungsnachweise eine wesentliche Unsicherheit in Bezug auf Ereignisse oder Bedingungen besteht, die die Fähigkeit des Fonds oder eines jeden seiner Teilfonds zur Fortführung der Unternehmenstätigkeit ernsthaft in Zweifel stellen könnten. Wenn wir zu dem Schluss kommen, dass eine wesentliche Unsicherheit besteht, sind wir verpflichtet, in unserem Prüfbericht auf die entsprechenden Offenlegungen im Abschluss hinzuweisen bzw. unseren Bestätigungsvermerk zu ändern, falls die Offenlegungen unangemessen sind. Unsere Schlussfolgerung beruht auf den bis zum Datum unseres Prüfberichts erlangten Prüfungsnachweisen. Künftige Ereignisse oder Bedingungen können jedoch dazu führen, dass die Fortführung der Unternehmenstätigkeit des Fonds oder eines seiner Teilfonds nicht länger gegeben ist (mit Ausnahme des HSBC Global Investment Funds – Latin America Equity und des HSBC Global Investment Funds – Indonesia Bond, für die ein Liquidationsbeschluss vorliegt, wie in Erläuterung 20 dargelegt).
- Beurteilung der Gesamtdarstellung und Struktur des Abschlusses sowie seines Inhalts, einschließlich der Offenlegungen, und der Frage, ob die Grundgeschäfte und Ereignisse im Abschluss so dargestellt sind, dass ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild erreicht wird.

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

PricewaterhouseCoopers, Société coopérative  
Vertreten durch

Luxemburg, 30. Juli 2024

Christelle Crépin

# Aufstellung des Nettovermögens

zum 31. März 2024

| Erläuterungen   | KONSOLIDIERT<br>USD    | Aktien-<br>teifonds      |                                |   |
|---|------------------------|--------------------------|--------------------------------|---|
|   |                        | ASEAN<br>Equity *<br>USD | Asia ex Japan<br>Equity<br>USD | Asia ex Japan<br>Equity Smaller<br>Companies<br>USD |
| <b>AKTIVA</b>   |                        |                          |                                |   |
| Anlagen in Wertpapieren zu Anschaffungskosten                       | 32.239.840.841         | 28.454.449               | 264.498.764                    | 358.794.773   |
| Nicht realisierter (Wertverlust)/Wertzuwachs                        | 2.b 630.755.254        | (1.200.230)              | 39.615.245                     | 25.295.022  |
| Anlagen in Wertpapieren zum Marktwert                               | 32.870.596.095         | 27.254.219               | 304.114.009                    | 384.089.795   |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten               | 2.b 63.692.882         | -                        | 543                            | -   |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures                               | 2.b 34.286.818         | -                        | -                              | -   |
| Nicht realisierter Gewinn aus Swaps                                 | 2.b 5.073.356          | -                        | -                              | -   |
| Nicht realisierter Gewinn aus Optionen                              | 2.b 1.069.574          | -                        | -                              | -   |
| Bankguthaben  | 813.032.973            | 147.383                  | 4.490.838                      | 9.175.138   |
| Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto                        | 290.813.146            | 261.777                  | 1.404.631                      | 2.163.024   |
| Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren                        | 88.046.974             | 887                      | 1.511.311                      | 5.656.169   |
| Forderungen aus nicht abgewickelten Spot-Devisentransaktionen       | 199.316.790            | 8.603                    | 4.701.843                      | 7.601.167   |
| Forderungen gegenüber Anteilinhabern                                | 305.285.076            | 17.068                   | 594.392                        | 107.557   |
| Sonstige Vermögenswerte   | 11.282.705             | -                        | 1.694.005                      | 7   |
| <b>Summe Aktiva</b>   | <b>34.682.496.389</b>  | <b>27.689.937</b>        | <b>318.511.572</b>             | <b>408.792.857</b>                                  |
| <b>PASSIVA</b>  |                        |                          |                                |   |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften              | 2.b (106.497.338)      | -                        | (118.393)                      | -   |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures                              | 2.b (23.928.873)       | -                        | -                              | -   |
| Nicht realisierter Verlust aus Swaps                                | 2.b (15.475.637)       | -                        | -                              | -   |
| Nicht realisierter Verlust aus Optionen                             | 2.b (1.825.962)        | -                        | -                              | -   |
| Banküberziehungen   | (232.283.548)          | -                        | (42.969)                       | (280.161)   |
| Verbindlichkeiten aus dem Kauf von Wertpapieren                     | (337.415.891)          | -                        | -                              | (6.419.029)   |
| Verbindlichkeiten aus nicht abgewickelten Spot-Devisentransaktionen | (199.343.791)          | (8.619)                  | (4.715.848)                    | (7.604.725)   |
| Verbindlichkeiten gegenüber Anteilinhabern                          | (269.821.692)          | (120.192)                | (5.013.820)                    | (347.116)   |
| Dividende – zahlbar   | (162.744.434)          | -                        | -                              | -   |
| Sonstige Verbindlichkeiten  | (79.643.192)           | (64.167)                 | (1.159.850)                    | (1.509.957)   |
| <b>Summe Passiva</b>  | <b>(1.428.980.358)</b> | <b>(192.978)</b>         | <b>(11.050.880)</b>            | <b>(16.160.988)</b>                                 |
| <b>Gesamtnettovermögen</b>  | <b>33.253.516.031</b>  | <b>27.496.959</b>        | <b>307.460.692</b>             | <b>392.631.869</b>                                  |

## ZWEIJAHRES-VERMÖGENSZUSAMMENFASSUNG

|               |                |            |             |             |
|---------------|----------------|------------|-------------|-------------|
| 31. März 2023 | 30.657.560.942 | 36.051.444 | 441.953.669 | 488.947.322 |
| 31. März 2022 | 35.668.923.650 | 40.410.175 | 584.891.399 | 758.828.482 |

\* Bis zum 31. Juli 2023 lautete der Name des Teilfonds „Thai Equity“.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung des Nettovermögens

zum 31. März 2024

| Asia Pacific ex<br>Japan Equity<br>High Dividend<br>USD | China A-Shares<br>Equity<br>USD | Chinese Equity<br>USD | Euroland<br>Equity Smaller<br>Companies<br>EUR | Euroland<br>Growth<br>EUR | Euroland Value<br>EUR | Europe Value<br>EUR |
|---|---------------------------------|-----------------------|--|---------------------------|-----------------------|---------------------|
| 261.624.864   | 22.844.588                      | 568.898.938           | 90.887.933                                     | 146.362.729               | 204.805.818           | 52.252.378          |
| 7.062.026   | 957.307                         | 7.266.737             | 9.590.006                                      | 52.242.974                | 42.236.993            | 8.529.645           |
| 268.686.890   | 23.801.895                      | 576.165.675           | 100.477.939                                    | 198.605.703               | 247.042.811           | 60.782.023          |
| 1.421   | -                               | -                     | 415  | -                         | 29.617                | -                   |
| -   | -                               | -                     | -  | 83.200                    | 99.000                | -                   |
| -   | -                               | -                     | -  | -                         | -                     | -                   |
| -   | -                               | -                     | -  | -                         | -                     | -                   |
| 1.019.959   | 10.700                          | 9.123.893             | 2.867.930                                      | 18.215.367                | 12.349.954            | 616.729             |
| 1.999.913   | 977                             | 197.220               | 177.624  | 118.251                   | 151.459               | 177.797             |
| 1.575.510   | -                               | 1.731.249             | 342.433  | -                         | -                     | 6.002.919           |
| 1.335.021   | 840.283                         | 7.546.318             | 144  | -                         | 299.756               | 2.102.833           |
| 671.661   | 2.060                           | 13.574.516            | 438  | 50.535                    | 289.785               | 21.632              |
| 655.884   | -                               | 2.585                 | 927.978  | 525.715                   | 2.277.990             | 240.207             |
| <b>275.946.259</b>                                      | <b>24.655.915</b>               | <b>608.341.456</b>    | <b>104.794.901</b>                             | <b>217.598.771</b>        | <b>262.540.372</b>    | <b>69.944.140</b>   |
| (41.376)  | -                               | -                     | -  | -                         | (1.233)               | -                   |
| -   | (125)                           | -                     | -  | -                         | -                     | -                   |
| -   | -                               | -                     | -  | -                         | -                     | -                   |
| -   | -                               | -                     | -  | -                         | -                     | -                   |
| (315.130)   | (63.027)                        | (94.461)              | -  | (670.772)                 | (282.891)             | -                   |
| (1.498.610)   | -                               | (4.035.442)           | -  | -                         | -                     | -                   |
| (1.337.979)   | (840.274)                       | (7.551.474)           | (145)  | -                         | (300.536)             | (2.106.357)         |
| (1.443.403)   | (31.397)                        | (14.416.852)          | (971.212)                                      | (16.821.938)              | (9.805.308)           | (6.067.233)         |
| (244.538)   | -                               | -                     | -  | -                         | (2.060)               | -                   |
| (1.081.999)   | (6.091)                         | (828.478)             | (97.500)                                       | (212.516)                 | (221.339)             | (63.840)            |
| <b>(5.963.035)</b>                                      | <b>(940.914)</b>                | <b>(26.926.707)</b>   | <b>(1.068.857)</b>                             | <b>(17.705.226)</b>       | <b>(10.613.367)</b>   | <b>(8.237.430)</b>  |
| <b>269.983.224</b>                                      | <b>23.715.001</b>               | <b>581.414.749</b>    | <b>103.726.044</b>                             | <b>199.893.545</b>        | <b>251.927.005</b>    | <b>61.706.710</b>   |
| 413.697.275   | 20.952.438                      | 761.626.018           | 109.218.855                                    | 287.493.353               | 298.987.918           | 78.922.996          |
| 423.674.273   | 23.132.398                      | 890.685.985           | 153.070.988                                    | 247.883.485               | 523.701.679           | 80.552.228          |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



# Aufstellung des Nettovermögens

zum 31. März 2024

| Erläuterungen   | Global<br>Emerging<br>Markets<br>Equity<br>USD | Global Equity<br>Circular<br>Economy<br>USD | Global Equity<br>Climate<br>Change<br>USD | Global Equity<br>Sustainable<br>Healthcare<br>USD |
|---|--|---|---|---|
| <b>AKTIVA</b>   |  |   |   |   |
| Anlagen in Wertpapieren zu Anschaffungskosten                       | 360.901.157                                    | 94.656.765                                  | 279.062.428                               | 237.636.487                                       |
| Nicht realisierter (Wertverlust)/Wertzuwachs                        | 2.b<br>1.062.184                               | 16.047.755                                  | 29.298.519                                | 49.829.281  |
| Anlagen in Wertpapieren zum Marktwert                               | 361.963.341                                    | 110.704.520                                 | 308.360.947                               | 287.465.768                                       |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten               | 2.b<br>-                                       | -   | 33  | 475   |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures                               | 2.b<br>-                                       | -   | -   | -   |
| Nicht realisierter Gewinn aus Swaps                                 | 2.b<br>-                                       | -   | -   | -   |
| Nicht realisierter Gewinn aus Optionen                              | 2.b<br>-                                       | -   | -   | -   |
| Bankguthaben  | 7.308.703                                      | 1.927.539                                   | 2.770.818                                 | 4.123.868   |
| Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto                        | 2.433.186                                      | 231.609                                     | 370.915                                   | 106.609   |
| Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren                        | 2.252.872                                      | -   | -   | -   |
| Forderungen aus nicht abgewickelten Spot-Devisentransaktionen       | 4.994.333                                      | 56.952                                      | 97.248                                    | 12.321.532  |
| Forderungen gegenüber Anteilhabern                                  | 589.752  | 55.578                                      | 1.586.693                                 | 13.241.120  |
| Sonstige Vermögenswerte   | 685.955  | 20.093                                      | 151.812                                   | 34.182  |
| <b>Summe Aktiva</b>   | <b>380.228.142</b>                             | <b>112.996.291</b>                          | <b>313.338.466</b>                        | <b>317.293.554</b>                                |
| <b>PASSIVA</b>  |  |   |   |   |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften              | 2.b<br>-                                       | -   | (7.835)                                   | (76.511)  |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures                              | 2.b<br>-                                       | -   | -   | -   |
| Nicht realisierter Verlust aus Swaps                                | 2.b<br>-                                       | -   | -   | -   |
| Nicht realisierter Verlust aus Optionen                             | 2.b<br>-                                       | -   | -   | -   |
| Banküberziehungen   | (407)  | -   | (42)                                      | (44.273)  |
| Verbindlichkeiten aus dem Kauf von Wertpapieren                     | (200.252)                                      | -   | -   | (1.709.321)                                       |
| Verbindlichkeiten aus nicht abgewickelten Spot-Devisentransaktionen | (5.011.402)                                    | (56.750)                                    | (97.253)                                  | (12.295.789)                                      |
| Verbindlichkeiten gegenüber Anteilhabern                            | (4.921.644)                                    | (2.422)                                     | (1.954.640)                               | (699.417)   |
| Dividende – zahlbar   | -  | -   | (249.318)                                 | -   |
| Sonstige Verbindlichkeiten  | (1.956.346)                                    | (71.512)                                    | (285.127)                                 | (220.101)   |
| <b>Summe Passiva</b>  | <b>(12.090.051)</b>                            | <b>(130.684)</b>                            | <b>(2.594.215)</b>                        | <b>(15.045.412)</b>                               |
| <b>Gesamtnettovermögen</b>  | <b>368.138.091</b>                             | <b>112.865.607</b>                          | <b>310.744.251</b>                        | <b>302.248.142</b>                                |

## ZWEIJAHRES-VERMÖGENSZUSAMMENFASSUNG

|               |             |            |             |             |
|---------------|-------------|------------|-------------|-------------|
| 31. März 2023 | 401.621.285 | 29.600.886 | 297.237.965 | 136.633.554 |
| 31. März 2022 | 349.052.270 | -          | 344.903.678 | 121.705.058 |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung des Nettovermögens

zum 31. März 2024

| Global Infrastructure Equity USD | Global Lower Carbon Equity USD | Global Real Estate Equity USD | Global Sustainable Equity Income USD | Global Sustainable Long Term Dividend USD | Global Sustainable Long Term Equity USD | Hong Kong Equity USD |
|----------------------------------|--------------------------------|-------------------------------|--------------------------------------|---|---|----------------------|
| 827.094.804                      | 303.726.334                    | 655.097.494                   | 211.543.167                          | 43.987.138                                | 93.508.027                              | 128.165.801          |
| 53.479.682                       | 64.191.196                     | (20.582.600)                  | 32.964.163                           | 3.443.212                                 | 13.476.660                              | (6.391.994)          |
| 880.574.486                      | 367.917.530                    | 634.514.894                   | 244.507.330                          | 47.430.350                                | 106.984.687                             | 121.773.807          |
| -                                | -                              | 3                             | -                                    | -   | -                                       | -                    |
| -                                | 126.232                        | -                             | 43.890                               | -   | -                                       | -                    |
| -                                | -                              | -                             | -                                    | -   | -                                       | -                    |
| -                                | -                              | -                             | -                                    | -   | -                                       | -                    |
| 569.088                          | 5.728.960                      | 9.142.979                     | 1.957.937                            | 5.558.918                                 | 1.708.751                               | 2.857.692            |
| 3.261.214                        | 1.197.129                      | 5.139.468                     | 1.008.384                            | 95.967                                    | 121.980                                 | 498.768              |
| 3.046.037                        | -                              | 47.544                        | 953.993                              | -   | -                                       | 1.113.326            |
| 861.712                          | 547.684                        | 182.383                       | -                                    | 1.002.461                                 | 535.408                                 | 22.267               |
| 9.046.235                        | 2.930.974                      | 3.262.998                     | 3.456.319                            | 1.119.463                                 | 2.037.242                               | 1.595.852            |
| 174                              | 329.561                        | 185.543                       | 103.563                              | 71.007                                    | 17.105                                  | 877                  |
| <b>897.358.946</b>               | <b>378.778.070</b>             | <b>652.475.812</b>            | <b>252.031.416</b>                   | <b>55.278.166</b>                         | <b>111.405.173</b>                      | <b>127.862.589</b>   |
| (167.324)                        | -                              | (967)                         | -                                    | -   | -                                       | -                    |
| -                                | -                              | -                             | -                                    | -   | -                                       | -                    |
| -                                | -                              | -                             | -                                    | -   | -                                       | -                    |
| -                                | -                              | -                             | -                                    | -   | -                                       | -                    |
| (3.375.650)                      | (195.088)                      | -                             | -                                    | (16.818)                                  | (2.012)                                 | (474.849)            |
| (3.044.673)                      | -                              | -                             | -                                    | (297.445)                                 | (1.643.372)                             | (1.484.560)          |
| (860.925)                        | (549.351)                      | (182.414)                     | -                                    | (1.001.534)                               | (535.412)                               | (22.331)             |
| (4.491.335)                      | (4.235.496)                    | (2.921.857)                   | (4.131.394)                          | (5.621.253)                               | (365.576)                               | (345.502)            |
| (1.198.629)                      | (714.570)                      | (4.480.391)                   | (1.267.492)                          | (57.709)                                  | (185.435)                               | -                    |
| (940.000)                        | (381.945)                      | (1.294.400)                   | (159.099)                            | (86.553)                                  | (39.529)                                | (138.533)            |
| <b>(14.078.536)</b>              | <b>(6.076.450)</b>             | <b>(8.880.029)</b>            | <b>(5.557.985)</b>                   | <b>(7.081.312)</b>                        | <b>(2.771.336)</b>                      | <b>(2.465.775)</b>   |
| <b>883.280.410</b>               | <b>372.701.620</b>             | <b>643.595.783</b>            | <b>246.473.431</b>                   | <b>48.196.854</b>                         | <b>108.633.837</b>                      | <b>125.396.814</b>   |
| 651.906.409                      | 270.407.334                    | 690.088.043                   | 150.650.459                          | 23.651.672                                | 11.496.568                              | 137.904.206          |
| 27.011.621                       | 283.058.434                    | 1.545.270.459                 | -                                    | 56.146.776                                | -                                       | 110.934.711          |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung des Nettovermögens

zum 31. März 2024

| Internationale<br>und regionale<br>Aktiefonds                       |                      |                                 |                            |   |  |
|---|----------------------|---------------------------------|----------------------------|---|--|
| Erläuterungen   | BRIC Equity**<br>USD | BRIC Markets<br>Equity**<br>USD | Frontier<br>Markets<br>USD | Global Equity<br>Volatility<br>Focused**<br>USD |  |
| <b>AKTIVA</b>   |                      |                                 |                            |   |  |
| Anlagen in Wertpapieren zu Anschaffungskosten                       | 128.053.789          | 48.151.786                      | 385.996.656                | 110.484.768                                     |  |
| Nicht realisierter (Wertverlust)/Wertzuwachs                        | 2.b<br>(27.307.223)  | (8.430.467)                     | 59.856.270                 | 17.660.407                                      |  |
| Anlagen in Wertpapieren zum Marktwert                               | 100.746.566          | 39.721.319                      | 445.852.926                | 128.145.175                                     |  |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten               | 2.b<br>-             | -                               | -                          | 910   |  |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures                               | 2.b<br>-             | -                               | -                          | 17.464  |  |
| Nicht realisierter Gewinn aus Swaps                                 | 2.b<br>-             | -                               | -                          | -   |  |
| Nicht realisierter Gewinn aus Optionen                              | 2.b<br>-             | -                               | -                          | -   |  |
| Bankguthaben  | 1.595.565            | 887.408                         | 4.808.525                  | 1.571.965                                       |  |
| Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto                        | 610.008              | 240.832                         | 1.869.142                  | 539.716   |  |
| Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren                        | 647.752              | 256.728                         | 250.837                    | 2.753.315                                       |  |
| Forderungen aus nicht abgewickelten Spot-Devisentransaktionen       | 50.637               | 33.036                          | 1.747.486                  | 6.130.263                                       |  |
| Forderungen gegenüber Anteilhabern                                  | 15.995               | 32.596                          | 2.105.568                  | 480.884   |  |
| Sonstige Vermögenswerte   | 5                    | 2                               | 51.716                     | 124.387   |  |
| <b>Summe Aktiva</b>   | <b>103.666.528</b>   | <b>41.171.921</b>               | <b>456.686.200</b>         | <b>139.764.079</b>                              |  |
| <b>PASSIVA</b>  |                      |                                 |                            |   |  |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften              | 2.b<br>-             | -                               | -                          | (192.419)                                       |  |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures                              | 2.b<br>-             | -                               | -                          | (165)   |  |
| Nicht realisierter Verlust aus Swaps                                | 2.b<br>-             | -                               | -                          | -   |  |
| Nicht realisierter Verlust aus Optionen                             | 2.b<br>-             | -                               | -                          | -   |  |
| Banküberziehungen   | (353)                | (19.712)                        | (413.692)                  | (57.232)  |  |
| Verbindlichkeiten aus dem Kauf von Wertpapieren                     | (697.646)            | (277.222)                       | (1.290.863)                | (1.436.435)                                     |  |
| Verbindlichkeiten aus nicht abgewickelten Spot-Devisentransaktionen | (50.653)             | (33.069)                        | (1.772.045)                | (6.131.305)                                     |  |
| Verbindlichkeiten gegenüber Anteilhabern                            | (156.236)            | (169.215)                       | (361.171)                  | (2.407.095)                                     |  |
| Dividende – zahlbar   | -                    | -                               | -                          | (107.260)                                       |  |
| Sonstige Verbindlichkeiten  | (1.309.229)          | (480.792)                       | (613.087)                  | (300.874)                                       |  |
| <b>Summe Passiva</b>  | <b>(2.214.117)</b>   | <b>(980.010)</b>                | <b>(4.450.858)</b>         | <b>(10.632.785)</b>                             |  |
| <b>Gesamtnettovermögen</b>  | <b>101.452.411</b>   | <b>40.191.911</b>               | <b>452.235.342</b>         | <b>129.131.294</b>                              |  |

## ZWEIJAHRES-VERMÖGENSZUSAMMENFASSUNG

|               |             |            |             |             |
|---------------|-------------|------------|-------------|-------------|
| 31. März 2023 | 112.091.346 | 42.001.466 | 235.789.493 | 118.997.825 |
| 31. März 2022 | 196.525.505 | 86.965.266 | 237.399.268 | 132.343.709 |

\*\* Aufgrund der Marktgegebenheiten infolge der Ukraine- und Russland-Krise seit dem 25. Februar 2022 haben der Ausschuss für die Preisbestimmung und die Verwaltungsgesellschaft vereinbart und veranlasst, dass alle auf Rubel lautenden russischen Aktien im Anlageportfolio auf null abgeschrieben werden.

# Aufstellung des Nettovermögens

zum 31. März 2024

| Marktspezifische Aktiendfonds |                              |                      |                    |                    | Rententeildfonds    |                   |
|-------------------------------|------------------------------|----------------------|--------------------|--------------------|---------------------|-------------------|
| Brazil Equity USD             | Economic Scale US Equity USD | Indian Equity USD    | Russia Equity* USD | Turkey Equity EUR  | Asia Bond USD       | Asia ESG Bond USD |
| 138.637.685                   | 196.643.078                  | 884.393.526          | 99.418.659         | 85.940.439         | 372.959.817         | 25.936.461        |
| 6.291.591                     | 67.082.261                   | 560.794.988          | (99.418.659)       | 6.877.797          | (16.685.642)        | (106.116)         |
| 144.929.276                   | 263.725.339                  | 1.445.188.514        | -                  | 92.818.236         | 356.274.175         | 25.830.345        |
| -                             | 679                          | -                    | -                  | -                  | 519.017             | -                 |
| -                             | 50.489                       | -                    | -                  | -                  | 74.998              | -                 |
| -                             | -                            | -                    | -                  | -                  | -                   | -                 |
| -                             | -                            | -                    | -                  | -                  | -                   | -                 |
| 2.492.775                     | 3.062.993                    | 18.817.933           | 11.743.576         | 2.651.346          | 4.564.557           | 356.222           |
| 1.239.091                     | 359.234                      | 797.840              | 43.753             | 290.317            | 3.883.272           | 267.606           |
| -                             | -                            | 688.444              | -                  | -                  | -                   | -                 |
| 236.700                       | 392.691                      | 2.245.165            | -                  | -                  | 717.866             | 632               |
| 732.862                       | 1.133.632                    | 16.537.992           | -                  | 1.055.501          | 5.436.366           | 632               |
| -                             | -                            | -                    | -                  | 956                | -                   | -                 |
| <b>149.630.704</b>            | <b>268.725.057</b>           | <b>1.484.275.888</b> | <b>11.787.329</b>  | <b>96.816.356</b>  | <b>371.470.251</b>  | <b>26.455.437</b> |
| -                             | (462.650)                    | -                    | -                  | -                  | (3.002.547)         | (1.643)           |
| -                             | -                            | -                    | -                  | -                  | (47.781)            | -                 |
| -                             | -                            | -                    | -                  | -                  | (53.826)            | -                 |
| -                             | -                            | -                    | -                  | -                  | -                   | -                 |
| (11.028)                      | (115.677)                    | (186.272)            | -                  | (33.222)           | (624.721)           | -                 |
| -                             | -                            | (385.571)            | -                  | -                  | (3.274.881)         | (384.563)         |
| (237.433)                     | (392.299)                    | (2.242.869)          | -                  | -                  | (718.973)           | (632)             |
| (865.896)                     | (1.828.360)                  | (12.658.349)         | -                  | (1.402.515)        | (1.431.926)         | -                 |
| -                             | -                            | -                    | -                  | -                  | (3.512.512)         | (2.539)           |
| (312.211)                     | (268.751)                    | (55.719.812)         | -                  | (164.795)          | (94.208)            | (5.419)           |
| <b>(1.426.568)</b>            | <b>(3.067.737)</b>           | <b>(71.192.873)</b>  | <b>-</b>           | <b>(1.600.532)</b> | <b>(12.761.375)</b> | <b>(394.796)</b>  |
| <b>148.204.136</b>            | <b>265.657.320</b>           | <b>1.413.083.015</b> | <b>11.787.329</b>  | <b>95.215.824</b>  | <b>358.708.876</b>  | <b>26.060.641</b> |
| 139.910.375                   | 260.843.203                  | 953.319.973          | 10.312.334         | 99.347.576         | 491.814.430         | 45.388.691        |
| 163.539.216                   | 333.553.195                  | 1.113.713.545        | 12.805.978         | 45.345.681         | 499.733.976         | 47.704.166        |

\* Der Handel und die Berechnung des offiziellen Nettoinventarwerts des Teilfonds Russia Equity sind seit 25. Februar 2022 aufgrund der Schließung der Moskauer Börse ausgesetzt. Ein indikativer Nettoinventarwert zum 31. März 2024 wurde lediglich zu Darstellungszwecken im Jahresabschluss errechnet. Der Ausschuss für die Preisbestimmung und die Verwaltungsgesellschaft haben vereinbart und veranlasst, dass alle auf Rubel lautenden russischen Aktien im Anlageportfolio auf null abgeschrieben werden.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung des Nettovermögens

zum 31. März 2024

|   | Erläuterungen | Asia High<br>Yield Bond<br>USD | Asian<br>Currencies<br>Bond<br>USD | Brazil Bond<br>USD | Corporate<br>Euro Bond<br>Fixed Term<br>2027<br>(aufgelegt<br>zum 30. Juni<br>2023)<br>EUR |
|---|---------------|--------------------------------|------------------------------------|--------------------|--|
| <b>AKTIVA</b>   |               |                                |                                    |                    |  |
| Anlagen in Wertpapieren zu Anschaffungskosten                       |               | 697.348.550                    | 27.579.497                         | 37.753.271         | 175.246.185  |
| Nicht realisierter (Wertverlust)/Wertzuwachs                        | 2.b           | (46.821.193)                   | (4.519.944)                        | 6.062              | 3.578.119  |
| Anlagen in Wertpapieren zum Marktwert                               |               | 650.527.357                    | 23.059.553                         | 37.759.333         | 178.824.304  |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten               | 2.b           | 920.033                        | 11.032                             | -                  | 36.543   |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures                               | 2.b           | 77.879                         | -                                  | -                  | -  |
| Nicht realisierter Gewinn aus Swaps                                 | 2.b           | -                              | -                                  | -                  | -  |
| Nicht realisierter Gewinn aus Optionen                              | 2.b           | -                              | -                                  | -                  | -  |
| Bankguthaben  |               | 15.368.018                     | 151.608                            | 175.151            | 1.376  |
| Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto                        |               | 11.497.817                     | 210.454                            | 507.480            | 2.721.548  |
| Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren                        |               | 7.758.056                      | -                                  | 20.458             | -  |
| Forderungen aus nicht abgewickelten Spot-Devisentransaktionen       |               | 293.869                        | -                                  | 61.100             | -  |
| Forderungen gegenüber Anteilinhabern                                |               | 887.835                        | -                                  | 37.140             | 2.351.663  |
| Sonstige Vermögenswerte   |               | -                              | -                                  | -                  | -  |
| <b>Summe Aktiva</b>   |               | <b>687.330.864</b>             | <b>23.432.647</b>                  | <b>38.560.662</b>  | <b>183.935.434</b>   |
| <b>PASSIVA</b>  |               |                                |                                    |                    |  |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften              | 2.b           | (1.849.889)                    | (8.179)                            | -                  | -  |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures                              | 2.b           | -                              | -                                  | -                  | -  |
| Nicht realisierter Verlust aus Swaps                                | 2.b           | (125.594)                      | -                                  | -                  | -  |
| Nicht realisierter Verlust aus Optionen                             | 2.b           | -                              | -                                  | -                  | -  |
| Banküberziehungen   |               | (845.869)                      | -                                  | (40)               | (651.747)  |
| Verbindlichkeiten aus dem Kauf von Wertpapieren                     |               | (7.935.026)                    | -                                  | -                  | (1.689.305)  |
| Verbindlichkeiten aus nicht abgewickelten Spot-Devisentransaktionen |               | (293.642)                      | -                                  | (61.069)           | -  |
| Verbindlichkeiten gegenüber Anteilinhabern                          |               | (2.265.608)                    | (1.228)                            | (160.144)          | (1.224)  |
| Dividende – zahlbar   |               | (6.302.351)                    | -                                  | -                  | -  |
| Sonstige Verbindlichkeiten  |               | (577.641)                      | (7.801)                            | (37.915)           | (94.379)   |
| <b>Summe Passiva</b>  |               | <b>(20.195.620)</b>            | <b>(17.208)</b>                    | <b>(259.168)</b>   | <b>(2.436.655)</b>   |
| <b>Gesamtnettovermögen</b>  |               | <b>667.135.244</b>             | <b>23.415.439</b>                  | <b>38.301.494</b>  | <b>181.498.779</b>   |

## ZWEIJAHRES-VERMÖGENSZUSAMMENFASSUNG

|               |               |            |            |   |
|---------------|---------------|------------|------------|---|
| 31 March 2023 | 1.142.030.519 | 35.053.330 | 31.846.377 | - |
| 31 March 2022 | 2.467.389.690 | 46.698.461 | 31.688.944 | - |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung des Nettovermögens

zum 31. März 2024

| Euro Bond<br>EUR  | Euro Bond<br>Total Return<br>EUR | Euro Credit<br>Bond<br>EUR | Euro High Yield<br>Bond<br>EUR | ESG Short<br>Duration Credit<br>Bond<br>USD | GEM Debt Total<br>Return<br>USD | Global Bond<br>USD  |
|-------------------|----------------------------------|----------------------------|--------------------------------|---|---------------------------------|---------------------|
| 60.787.213        | 82.580.468                       | 406.387.127                | 762.631.845                    | 7.332.890                                   | 34.153.158                      | 42.432.754          |
| (6.415.556)       | 1.567.408                        | 8.994.127                  | (21.413.820)                   | 64.545                                      | (498.381)                       | (1.226.159)         |
| 54.371.657        | 84.147.876                       | 415.381.254                | 741.218.025                    | 7.397.435                                   | 33.654.777                      | 41.206.595          |
| -                 | 24.619                           | -                          | 97.259                         | 3.796                                       | 858.146                         | 50.318              |
| -                 | 15.734                           | -                          | -                              | 387   | 2.746                           | 10.140              |
| -                 | -                                | -                          | -                              | -   | 24.640                          | -                   |
| -                 | -                                | -                          | -                              | -   | 58.282                          | -                   |
| 707.094           | 8.975.239                        | 6.307.250                  | 18.967.488                     | 30.007                                      | 8.616.243                       | 6.128.324           |
| 631.462           | 834.293                          | 5.095.049                  | 12.680.016                     | 95.680                                      | 195.644                         | 334.936             |
| -                 | 1.036.820                        | 6.058.888                  | 4.169.057                      | -   | 2.687.587                       | -                   |
| -                 | -                                | 113.765                    | 158                            | 823.682                                     | 335.688                         | 97.200              |
| 215.117           | 18.042                           | 1.081.577                  | 23.166.756                     | -   | -                               | 8.897               |
| -                 | 18.749                           | 11.250                     | -                              | -   | -                               | 2.709               |
| <b>55.925.330</b> | <b>95.071.372</b>                | <b>434.049.033</b>         | <b>800.298.759</b>             | <b>8.350.987</b>                            | <b>46.433.753</b>               | <b>47.839.119</b>   |
| -                 | (62.716)                         | -                          | (31)                           | (31.625)                                    | (1.079.877)                     | (137.392)           |
| -                 | (48.831)                         | (73.500)                   | -                              | -   | (82.453)                        | (9.276)             |
| -                 | -                                | -                          | -                              | -   | (63.237)                        | (72.633)            |
| -                 | -                                | -                          | -                              | -   | (115.707)                       | -                   |
| (300.900)         | (1.840.155)                      | (2.433.572)                | (308.917)                      | (1.294)                                     | (5.320.481)                     | (5.600.236)         |
| -                 | -                                | (4.733.883)                | (12.896.073)                   | -   | (646.673)                       | (4.394.404)         |
| -                 | -                                | (113.500)                  | (159)                          | (822.799)                                   | (333.878)                       | (97.129)            |
| (215.431)         | (8.823)                          | (1.507.184)                | (32.485.783)                   | -   | (1.976.702)                     | (13.854)            |
| -                 | -                                | -                          | (153.787)                      | (72.186)                                    | -                               | (7.417)             |
| (20.407)          | (14.995)                         | (146.782)                  | (390.781)                      | (2.969)                                     | (43.700)                        | (12.404)            |
| <b>(536.738)</b>  | <b>(1.975.520)</b>               | <b>(9.008.421)</b>         | <b>(46.235.531)</b>            | <b>(930.873)</b>                            | <b>(9.662.708)</b>              | <b>(10.344.745)</b> |
| <b>55.388.592</b> | <b>93.095.852</b>                | <b>425.040.612</b>         | <b>754.063.228</b>             | <b>7.420.114</b>                            | <b>36.771.045</b>               | <b>37.494.374</b>   |
| 57.075.368        | 124.766.811                      | 345.254.148                | 1.041.658.661                  | 5.504.133                                   | 125.663.112                     | 37.000.893          |
| 111.508.277       | 170.400.970                      | 376.502.833                | 1.407.906.842                  | -   | 296.726.158                     | 44.611.096          |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung des Nettovermögens

zum 31. März 2024

|   | Erläuterungen | Global Bond<br>Total Return<br>USD | Global<br>Corporate<br>Bond<br>USD | Global<br>Emerging<br>Markets Bond<br>USD | Global<br>Emerging<br>Markets<br>Corporate<br>Sustainable<br>Bond<br>USD |
|---|---------------|------------------------------------|------------------------------------|---|--|
| <b>AKTIVA</b>   |               |                                    |                                    |   |  |
| Anlagen in Wertpapieren zu Anschaffungskosten                       |               | 217.597.016                        | 3.358.706.848                      | 1.017.792.547                             | 136.754.165  |
| Nicht realisierter (Wertverlust)/Wertzuwachs                        | 2.b           | (4.209.226)                        | (89.592.298)                       | (4.745.079)                               | 3.378.832  |
| Anlagen in Wertpapieren zum Marktwert                               |               | 213.387.790                        | 3.269.114.550                      | 1.013.047.468                             | 140.132.997  |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten               | 2.b           | 408.981                            | 11.006.591                         | 158.767                                   | 45.062   |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures                               | 2.b           | 254.459                            | 989.388                            | 525.417                                   | -  |
| Nicht realisierter Gewinn aus Swaps                                 | 2.b           | -                                  | -                                  | 27.359                                    | -  |
| Nicht realisierter Gewinn aus Optionen                              | 2.b           | -                                  | -                                  | -   | -  |
| Bankguthaben  |               | 11.734.362                         | 66.834.054                         | 19.804.757                                | 283.937  |
| Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto                        |               | 2.274.327                          | 39.269.297                         | 15.496.148                                | 2.391.365  |
| Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren                        |               | 456.725                            | -                                  | 10.884.971                                | -  |
| Forderungen aus nicht abgewickelten Spot-Devisentransaktionen       |               | 648.000                            | 13.104.074                         | 5.760.040                                 | -  |
| Forderungen gegenüber Anteilhabern                                  |               | 61.319                             | 22.672.106                         | 2.816.220                                 | -  |
| Sonstige Vermögenswerte   |               | 117                                | -                                  | 4.121                                     | -  |
| <b>Summe Aktiva</b>   |               | <b>229.226.080</b>                 | <b>3.422.990.060</b>               | <b>1.068.525.268</b>                      | <b>142.853.361</b>   |
| <b>PASSIVA</b>  |               |                                    |                                    |   |  |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften              | 2.b           | (1.150.022)                        | (14.421.740)                       | (4.445.793)                               | (11)   |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures                              | 2.b           | (167.887)                          | (132.548)                          | (860.524)                                 | -  |
| Nicht realisierter Verlust aus Swaps                                | 2.b           | -                                  | (35.559)                           | (230.472)                                 | -  |
| Nicht realisierter Verlust aus Optionen                             | 2.b           | -                                  | -                                  | -   | -  |
| Banküberziehungen   |               | (4.842.171)                        | (5.149.962)                        | (9.447.696)                               | -  |
| Verbindlichkeiten aus dem Kauf von Wertpapieren                     |               | (1.353.783)                        | (23.642.521)                       | (8.312.012)                               | -  |
| Verbindlichkeiten aus nicht abgewickelten Spot-Devisentransaktionen |               | (647.526)                          | (13.104.733)                       | (5.759.513)                               | -  |
| Verbindlichkeiten gegenüber Anteilhabern                            |               | (4.657)                            | (12.930.906)                       | (2.776.329)                               | -  |
| Dividende – zahlbar   |               | (534.077)                          | (31.800.633)                       | (12.914.504)                              | -  |
| Sonstige Verbindlichkeiten  |               | (27.936)                           | (306.842)                          | (273.419)                                 | (70.616)   |
| <b>Summe Passiva</b>  |               | <b>(8.728.059)</b>                 | <b>(101.525.444)</b>               | <b>(45.020.262)</b>                       | <b>(70.627)</b>  |
| <b>Gesamtnettovermögen</b>  |               | <b>220.498.021</b>                 | <b>3.321.464.616</b>               | <b>1.023.505.006</b>                      | <b>142.782.734</b>   |

## ZWEIJAHRES-VERMÖGENSZUSAMMENFASSUNG

|               |             |               |               |             |
|---------------|-------------|---------------|---------------|-------------|
| 31. März 2023 | 191.309.646 | 2.564.709.922 | 1.172.999.393 | 112.217.456 |
| 31. März 2022 | 245.779.656 | 3.175.404.930 | 1.682.091.114 | -           |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung des Nettovermögens

zum 31. März 2024

| Global Emerging Markets ESG Bond USD | Global Emerging Markets ESG Local Debt USD | Global Emerging Markets Local Debt USD | Global ESG Corporate Bond USD | Global Government Bond USD | Global Green Bond USD | Global High Income Bond USD |
|--------------------------------------|--|--|-------------------------------|----------------------------|-----------------------|-----------------------------|
| 83.826.953                           | 276.370.081                                | 923.101.537                            | 184.235.238                   | 4.380.969.996              | 61.898.250            | 884.357.731                 |
| 1.460.626                            | (426.182)                                  | (5.373.884)                            | (7.171.889)                   | (150.447.011)              | (766.196)             | (29.230.666)                |
| 85.287.579                           | 275.943.899                                | 917.727.653                            | 177.063.349                   | 4.230.522.985              | 61.132.054            | 855.127.065                 |
| 8.667                                | 1.026.040                                  | 4.425.815                              | 571.148                       | 18.026.880                 | 237.010               | 1.141.783                   |
| 16.699                               | 18.750                                     | 58.594                                 | 65.797                        | 3.441.082                  | -                     | 140.863                     |
| 273                                  | 115.448                                    | 613.080                                | -                             | -                          | -                     | 379.310                     |
| -                                    | 231.071                                    | 713.862                                | -                             | -                          | -                     | -                           |
| 1.156.928                            | 11.417.318                                 | 41.383.137                             | 4.389.944                     | 44.622.874                 | 852.775               | 31.194.010                  |
| 1.222.694                            | 5.430.464                                  | 7.446.354                              | 1.691.936                     | 33.849.188                 | 603.750               | 10.643.989                  |
| 538.196                              | -  | -                                      | -                             | -                          | -                     | 4.207.710                   |
| 514.019                              | 373.477                                    | 102.556                                | 751.789                       | 1.852.519                  | 85.907                | 15.607.998                  |
| 272.587                              | 1.319.710                                  | 2.299.017                              | 1.040.890                     | 24.014.598                 | 271.951               | 8.811.784                   |
| -                                    | 399.109                                    | 159.432                                | -                             | -                          | 385                   | 8.458                       |
| <b>89.017.642</b>                    | <b>296.275.286</b>                         | <b>974.929.500</b>                     | <b>185.574.853</b>            | <b>4.356.330.126</b>       | <b>63.183.832</b>     | <b>927.262.970</b>          |
| (454.771)                            | (2.403.431)                                | (12.883.506)                           | (623.503)                     | (21.104.130)               | (196.395)             | (2.212.642)                 |
| (61.547)                             | -  | -                                      | (37.071)                      | (2.192.834)                | -                     | (150.548)                   |
| (13.326)                             | -  | -                                      | -                             | (5.855.137)                | -                     | (1.490.696)                 |
| -                                    | (413.548)                                  | (1.268.201)                            | -                             | -                          | -                     | -                           |
| (345.290)                            | (5.536.351)                                | (27.439.442)                           | (625.879)                     | (28.462.762)               | (12.640)              | (7.972.651)                 |
| (858.821)                            | (210.644)                                  | -                                      | (574.515)                     | -                          | -                     | (3.970.370)                 |
| (513.951)                            | (371.754)                                  | (102.357)                              | (751.673)                     | (1.849.655)                | (85.877)              | (15.602.081)                |
| (203.019)                            | (4.467.131)                                | (4.180.796)                            | (741.044)                     | (4.980.900)                | (218.689)             | (4.512.441)                 |
| (1.159.898)                          | (1.662.625)                                | (10.683.493)                           | (1.575.374)                   | (29.001.821)               | (487.260)             | (4.769.484)                 |
| (14.655)                             | (106.539)                                  | (235.616)                              | (23.307)                      | (354.371)                  | (10.843)              | (989.375)                   |
| <b>(3.625.278)</b>                   | <b>(15.172.023)</b>                        | <b>(56.793.411)</b>                    | <b>(4.952.366)</b>            | <b>(93.801.610)</b>        | <b>(1.011.704)</b>    | <b>(41.670.288)</b>         |
| <b>85.392.364</b>                    | <b>281.103.263</b>                         | <b>918.136.089</b>                     | <b>180.622.487</b>            | <b>4.262.528.516</b>       | <b>62.172.128</b>     | <b>885.592.682</b>          |
| 100.352.835                          | 292.675.167                                | 1.274.054.242                          | 188.903.671                   | 2.962.519.709              | 26.633.159            | 789.795.418                 |
| 57.648.927                           | 202.368.836                                | 1.131.996.157                          | 203.593.794                   | 2.292.079.924              | 29.702.296            | 1.035.452.172               |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



# Aufstellung des Nettovermögens

zum 31. März 2024

|   | Erläuterungen | Global High<br>Yield Bond<br>USD | Global High<br>Yield ESG<br>Bond<br>USD | Global High<br>Yield<br>Securitized<br>Credit Bond<br>USD | Global<br>Inflation<br>Linked Bond<br>USD |
|---|---------------|----------------------------------|---|---|---|
| <b>AKTIVA</b>   |               |                                  |   |   |   |
| Anlagen in Wertpapieren zu Anschaffungskosten                       |               | 703.733.877                      | 33.973.830                              | 83.276.420  | 619.873.834                               |
| Nicht realisierter (Wertverlust)/Wertzuwachs                        | 2.b           | 11.738.204                       | 375.523                                 | (3.150.878)   | (37.443.195)                              |
| Anlagen in Wertpapieren zum Marktwert                               |               | 715.472.081                      | 34.349.353                              | 80.125.542  | 582.430.639                               |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten               | 2.b           | 980.524                          | 65.063                                  | 4.902   | 1.416.182                                 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures                               | 2.b           | 115.496                          | 6.398                                   | -   | 52.813                                    |
| Nicht realisierter Gewinn aus Swaps                                 | 2.b           | -                                | -                                       | -   | -   |
| Nicht realisierter Gewinn aus Optionen                              | 2.b           | -                                | -                                       | -   | -   |
| Bankguthaben  |               | 9.149.184                        | 261.788                                 | 3.915.677   | 7.570.899                                 |
| Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto                        |               | 11.804.782                       | 547.373                                 | 832.427   | 1.370.221                                 |
| Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren                        |               | 6.080.787                        | 236.858                                 | -   | -   |
| Forderungen aus nicht abgewickelten Spot-Devisentransaktionen       |               | 2.929.562                        | 599.877                                 | -   | 739.747                                   |
| Forderungen gegenüber Anteilhabern                                  |               | 1.674.261                        | 108.193                                 | -   | 1.591.505                                 |
| Sonstige Vermögenswerte   |               | -                                | 8.291                                   | -   | 1.102                                     |
| <b>Summe Aktiva</b>   |               | <b>748.206.677</b>               | <b>36.183.194</b>                       | <b>84.878.548</b>   | <b>595.173.108</b>                        |
| <b>PASSIVA</b>  |               |                                  |   |   |   |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften              | 2.b           | (2.951.928)                      | (149.962)                               | (65.383)  | (4.209.632)                               |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures                              | 2.b           | -                                | -                                       | -   | (192.155)                                 |
| Nicht realisierter Verlust aus Swaps                                | 2.b           | (105.072)                        | -                                       | -   | (468.179)                                 |
| Nicht realisierter Verlust aus Optionen                             | 2.b           | -                                | -                                       | -   | -   |
| Banküberziehungen   |               | (367.875)                        | (10.708)                                | (3.426.738)   | (4.014.961)                               |
| Verbindlichkeiten aus dem Kauf von Wertpapieren                     |               | (6.272.950)                      | (130.000)                               | -   | (639.921)                                 |
| Verbindlichkeiten aus nicht abgewickelten Spot-Devisentransaktionen |               | (2.930.431)                      | (599.316)                               | -   | (739.740)                                 |
| Verbindlichkeiten gegenüber Anteilhabern                            |               | (1.079.549)                      | (74.947)                                | -   | (994.774)                                 |
| Dividende – zahlbar   |               | (8.898.185)                      | (545.644)                               | (3.053)   | -   |
| Sonstige Verbindlichkeiten  |               | (216.465)                        | (5.487)                                 | (33.960)  | (84.762)                                  |
| <b>Summe Passiva</b>  |               | <b>(22.822.455)</b>              | <b>(1.516.064)</b>                      | <b>(3.529.134)</b>  | <b>(11.344.124)</b>                       |
| <b>Gesamt Nettovermögen</b>   |               | <b>725.384.222</b>               | <b>34.667.130</b>                       | <b>81.349.414</b>   | <b>583.828.984</b>                        |

## ZWEIJAHRES-VERMÖGENSZUSAMMENFASSUNG

|               |               |            |             |             |
|---------------|---------------|------------|-------------|-------------|
| 31. März 2023 | 1.109.671.579 | 40.685.992 | 128.096.185 | 642.492.437 |
| 31. März 2022 | 1.584.396.209 | 55.975.177 | 176.306.522 | 216.528.713 |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung des Nettovermögens

zum 31. März 2024

| Global Investment Grade Securitised Credit Bond USD | Global Lower Carbon Bond USD | Global Securitised Credit Bond USD | Global Short Duration Bond USD | India Fixed Income USD | RMB Fixed Income USD | Singapore Dollar Income Bond SGD |
|---|------------------------------|------------------------------------|--------------------------------|------------------------|----------------------|----------------------------------|
| 1.967.494.173                                       | 247.265.241                  | 92.623.441                         | 2.214.954.798                  | 778.895.910            | 216.488.725          | 247.865.713                      |
| (32.300.632)  | (4.737.500)                  | (3.003.600)                        | 19.036.615                     | 4.374.799              | (626.557)            | 1.884.350                        |
| 1.935.193.541                                       | 242.527.741                  | 89.619.841                         | 2.233.991.413                  | 783.270.709            | 215.862.168          | 249.750.063                      |
| 1.254.771   | 591.424                      | 28.068                             | 5.125.292                      | 131.442                | 19.206               | 481.118                          |
| -   | 87.120                       | -                                  | 114.306                        | -                      | -                    | -                                |
| -   | 13.706                       | -                                  | -                              | -                      | -                    | -                                |
| -   | -                            | -                                  | -                              | -                      | -                    | -                                |
| 10.433.510  | 6.636.205                    | 833.452                            | 13.243.004                     | 9.644.395              | 3.644.892            | 307.972                          |
| 16.272.226  | 2.554.894                    | 693.693                            | 23.162.530                     | 15.162.330             | 3.190.920            | 2.760.308                        |
| -   | -                            | -                                  | 7.153.650                      | -                      | 4.494.776            | 23.038                           |
| 10.688.465  | 1.380.768                    | 23.395.962                         | 23.861.849                     | 3.987.105              | 5.551.610            | 1.560.672                        |
| 26.966.161  | 2.698.295                    | -                                  | 37.268.676                     | 5.679.062              | 18.259               | 3.409.001                        |
| 1.645   | -                            | -                                  | 7.571                          | 2.026.036              | -                    | 51.427                           |
| <b>2.000.810.319</b>                                | <b>256.490.153</b>           | <b>114.571.016</b>                 | <b>2.343.928.291</b>           | <b>819.901.079</b>     | <b>232.781.831</b>   | <b>258.343.599</b>               |
| (7.386.441)   | (420.611)                    | (222.231)                          | (9.404.384)                    | (1.299.959)            | (371.591)            | (750.452)                        |
| -   | (3.798)                      | -                                  | (1.120.003)                    | -                      | -                    | -                                |
| -   | -                            | -                                  | (24.641)                       | -                      | -                    | -                                |
| -   | -                            | -                                  | -                              | -                      | -                    | -                                |
| (7.321.662)   | (979.453)                    | (406.480)                          | (7.786.928)                    | (595.952)              | (1.420.031)          | (772.234)                        |
| (26.611.998)  | (729.315)                    | -                                  | (19.351.681)                   | (3.098.621)            | (1.174.169)          | (2.623.041)                      |
| (10.685.153)  | (1.379.895)                  | (23.409.348)                       | (23.851.704)                   | (3.988.438)            | (5.554.387)          | (1.560.488)                      |
| (9.857.113)   | (2.751.388)                  | -                                  | (22.570.190)                   | (5.744.831)            | (4.862.863)          | (446.056)                        |
| (14.634.336)  | (1.303.523)                  | (831.657)                          | (10.607.805)                   | (3.348.066)            | (202.262)            | (997.489)                        |
| (775.805)   | (161.238)                    | (28.779)                           | (1.156.635)                    | (751.514)              | (142.316)            | (238.891)                        |
| <b>(77.272.508)</b>                                 | <b>(7.729.221)</b>           | <b>(24.898.495)</b>                | <b>(95.873.971)</b>            | <b>(18.827.381)</b>    | <b>(13.727.619)</b>  | <b>(7.388.651)</b>               |
| <b>1.923.537.811</b>                                | <b>248.760.932</b>           | <b>89.672.521</b>                  | <b>2.248.054.320</b>           | <b>801.073.698</b>     | <b>219.054.212</b>   | <b>250.954.948</b>               |
| 1.289.266.469                                       | 154.546.381                  | 80.739.259                         | 826.600.095                    | 536.054.875            | 269.969.776          | 192.593.971                      |
| 1.585.352.570                                       | 205.076.831                  | 130.141.948                        | 356.558.146                    | 662.544.643            | 392.041.420          | 241.717.313                      |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung des Nettovermögens

zum 31. März 2024

| Erläuterungen   | Ultra Short<br>Duration Bond<br>USD | US Dollar<br>Bond<br>USD | US High Yield<br>Bond<br>USD | US Short<br>Duration High<br>Yield Bond <sup>*</sup><br>USD |
|---|-------------------------------------|--------------------------|------------------------------|---|
| <b>AKTIVA</b>   |                                     |                          |                              |   |
| Anlagen in Wertpapieren zu Anschaffungskosten                       | 1.080.802.660                       | 435.929.725              | 41.866.643                   | 91.883.304  |
| Nicht realisierter (Wertverlust)/Wertzuwachs                        | 2.b 5.976.287                       | (2.350.137)              | (155.933)                    | 875.005   |
| Anlagen in Wertpapieren zum Marktwert                               | 1.086.778.947                       | 433.579.588              | 41.710.710                   | 92.758.309  |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten               | 2.b 43.085                          | 52                       | 16                           | 154.113   |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures                               | 2.b 31.173                          | 24.533                   | 3.031                        | -   |
| Nicht realisierter Gewinn aus Swaps                                 | 2.b -                               | -                        | -                            | -   |
| Nicht realisierter Gewinn aus Optionen                              | 2.b -                               | -                        | -                            | -   |
| Bankguthaben  | 5.759.648                           | 2.520.545                | 111.247                      | 1.061.438   |
| Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto                        | 9.159.077                           | 2.453.175                | 721.118                      | 1.531.665   |
| Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren                        | -                                   | -                        | 1.172.564                    | -   |
| Forderungen aus nicht abgewickelten Spot-Devisentransaktionen       | 19.132.742                          | 556.880                  | 70.948                       | 278.407   |
| Forderungen gegenüber Anteilinhabern                                | 25.946.202                          | 492.558                  | 153.523                      | 467.628   |
| Sonstige Vermögenswerte   | 1.613                               | 328                      | 7.464                        | 470   |
| <b>Summe Aktiva</b>   | <b>1.146.852.487</b>                | <b>439.627.659</b>       | <b>43.950.621</b>            | <b>96.252.030</b>   |
| <b>PASSIVA</b>  |                                     |                          |                              |   |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften              | 2.b (1.745.019)                     | (77.478)                 | (32.890)                     | (379.759)   |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures                              | 2.b -                               | (40.989)                 | -                            | -   |
| Nicht realisierter Verlust aus Swaps                                | 2.b -                               | -                        | (5.073)                      | -   |
| Nicht realisierter Verlust aus Optionen                             | 2.b -                               | -                        | -                            | -   |
| Banküberziehungen   | (9.940.147)                         | -                        | (39.925)                     | (197.000)   |
| Verbindlichkeiten aus dem Kauf von Wertpapieren                     | (16.317.624)                        | (102.683.625)            | (455.935)                    | (122.000)   |
| Verbindlichkeiten aus nicht abgewickelten Spot-Devisentransaktionen | (19.123.781)                        | (556.858)                | (70.981)                     | (278.837)   |
| Verbindlichkeiten gegenüber Anteilinhabern                          | (14.757.877)                        | (350.218)                | (15.870)                     | (452.739)   |
| Dividende – zahlbar   | (2.189.639)                         | (1.239.775)              | (75.183)                     | (1.224.905)   |
| Sonstige Verbindlichkeiten  | (315.277)                           | (227.404)                | (17.813)                     | (28.931)  |
| <b>Summe Passiva</b>  | <b>(64.389.364)</b>                 | <b>(105.176.347)</b>     | <b>(713.670)</b>             | <b>(2.684.171)</b>  |
| <b>Gesamtnettovermögen</b>  | <b>1.082.463.123</b>                | <b>334.451.312</b>       | <b>43.236.951</b>            | <b>93.567.859</b>   |

## ZWEIJAHRES-VERMÖGENSZUSAMMENFASSUNG

|               |             |             |            |             |
|---------------|-------------|-------------|------------|-------------|
| 31. März 2023 | 764.078.587 | 126.475.751 | 46.163.625 | 103.256.574 |
| 31. März 2022 | 830.545.882 | 82.977.554  | 63.733.408 | 164.859.347 |

\* Bis zum 2. Juli 2023 lautete der Name des Teilfonds „Global Short Duration High Yield Bond“.

# Aufstellung des Nettovermögens

zum 31. März 2024

| Sonstige Teilfonds                               |   |   |   |                               |                                  |                       |
|--|---|---|---|-------------------------------|----------------------------------|-----------------------|
| Global Emerging Markets Multi-Asset Income** USD | Managed Solutions – Asia Focused Conservative USD | Managed Solutions – Asia Focused Growth USD | Managed Solutions – Asia Focused Income USD | Multi-Asset Style Factors EUR | Multi-Strategy Target Return EUR | US Income Focused USD |
| 48.908.192                                       | 34.301.689  | 18.489.237                                  | 279.468.655                                 | 684.014.100                   | 88.013.232                       | 495.467.244           |
| (1.844.077)                                      | (2.295.691)                                       | (519.812)                                   | (5.557.654)                                 | 1.620.237                     | 1.023.142                        | 28.429.179            |
| 47.064.115                                       | 32.005.998  | 17.969.425                                  | 273.911.001                                 | 685.634.337                   | 89.036.374                       | 523.896.423           |
| 109.232  | 3.967   | 3.981                                       | 61.677                                      | 11.415.895                    | 1.282.942                        | 1.974                 |
| 4.493  | 9.011   | 8.071                                       | 104.988                                     | 23.182.346                    | 2.297.486                        | 78.126                |
| 10.568   | -   | -   | -   | 2.463.313                     | 1.137.587                        | -                     |
| 16.369   | -   | -   | -   | -                             | 46.287                           | -                     |
| 1.138.798  | 511.330   | 344.456                                     | 5.032.145                                   | 217.425.710                   | 21.534.654                       | 13.854.314            |
| 502.945  | 285.090   | 156.041                                     | 2.563.793                                   | 3.383.882                     | 33.974                           | 3.899.457             |
| 40.078   | -   | 29.542                                      | 50.456                                      | -                             | 39.330                           | 670.115               |
| 63.544   | 137   | 116   | 1.093.540                                   | 184.029                       | 93.167                           | 6.190.167             |
| 232.426  | 3.635   | 3.250                                       | 2.850.400                                   | 2.082.412                     | 4.944.996                        | 13.624.320            |
| 22.198   | 1.040   | 1.178                                       | 15.119                                      | 1.141                         | 53.685                           | 65.466                |
| <b>49.204.766</b>                                | <b>32.820.208</b>                                 | <b>18.516.060</b>                           | <b>285.683.119</b>                          | <b>945.773.065</b>            | <b>120.500.482</b>               | <b>562.280.362</b>    |
| (371.110)  | (62.588)  | (44.237)                                    | (803.026)                                   | (6.428.476)                   | (851.014)                        | (937.536)             |
| (13.915)   | (601)   | (492)                                       | (12.073)                                    | (16.051.534)                  | (1.235.477)                      | -                     |
| (2.038)  | -   | -   | -   | (6.040.574)                   | (376.236)                        | -                     |
| (28.506)   | -   | -   | -   | -                             | -                                | -                     |
| (330.767)  | (3.542)   | (31.825)                                    | (1.290.686)                                 | (68.551.201)                  | (2.978.245)                      | (1.314.590)           |
| (359.535)  | (198.172)   | -   | (1.303.880)                                 | (23.981.581)                  | -                                | (29.279.337)          |
| (63.430)   | (138)   | (116)                                       | (1.094.205)                                 | (184.493)                     | (93.258)                         | (6.189.455)           |
| (195.405)  | (156.284)   | (53.837)                                    | (2.172.866)                                 | (2.167.847)                   | (4.950.739)                      | (10.507.770)          |
| (253.044)  | (102.919)   | (4.909)                                     | (1.174.253)                                 | -                             | -                                | (2.206.346)           |
| (105.924)  | (20.546)  | (26.876)                                    | (398.532)                                   | (227.374)                     | (15.789)                         | (739.764)             |
| <b>(1.723.674)</b>                               | <b>(544.790)</b>                                  | <b>(162.292)</b>                            | <b>(8.249.521)</b>                          | <b>(123.633.080)</b>          | <b>(10.500.758)</b>              | <b>(51.174.798)</b>   |
| <b>47.481.092</b>                                | <b>32.275.418</b>                                 | <b>18.353.768</b>                           | <b>277.433.598</b>                          | <b>822.139.985</b>            | <b>109.999.724*</b>              | <b>511.105.564</b>    |
| 53.475.476                                       | 47.888.112  | 27.686.618                                  | 420.838.099                                 | 1.166.556.888                 | 108.915.477                      | 408.772.242           |
| 71.895.531                                       | 49.559.220  | 36.273.663                                  | 558.537.115                                 | 1.189.335.426                 | 108.801.928                      | 668.014.718           |

\*\* Aufgrund der Marktgegebenheiten infolge der Ukraine- und Russland-Krise seit dem 25. Februar 2022 haben der Ausschuss für die Preisbestimmung und die Verwaltungsgesellschaft vereinbart und veranlasst, dass alle auf Rubel lautenden russischen Aktien im Anlageportfolio auf null abgeschrieben werden,

+ Das Gesamtvermögen des Teilfonds und der Nettoinventarwert je Anteil der Anteilklassen IC, ICH GBP und ID wurden für das Berichtsjahr angepasst, nachdem nach dem Ende des Jahres am 16. April 2024 eine überhöhte Abgrenzung der aufgelaufenen Verwaltungsgebühren von insgesamt 122,656 USD festgestellt wurde,

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Wichtige Kennzahlen

zum 31. März 2024

| Teilfonds   | Gesamtkostenquote<br>(TER)/synthetische<br>TER |  | Anteile in Umlauf<br>31. März 2024 | Nettoinventarwert je Anteil* |               |               |
|---|--|--|------------------------------------|------------------------------|---------------|---------------|
|   | 31. März 2024<br>(siehe Erläuterung 15)        |  |                                    | 31. März 2024                | 31. März 2023 | 31. März 2022 |
| <b>ASEAN Equity ***<br/>USD</b>                           |  |  |                                    |                              |               |               |
| AC  | 1,85 %   |  | 79.544,250                         | 20,18                        | 21,27         | 22,96         |
| AD  | 1,86 %   |  | 1.534.984,500                      | 15,75                        | 16,90         | 18,41         |
| EC  | 2,36 %   |  | 84.283,962                         | 18,51                        | 19,60         | 21,27         |
| IC  | 1,00 %   |  | 6.404,822                          | 23,57                        | 24,63         | 26,36         |
| Gesamtnettovermögen                                       |  |  |                                    | 27.496.959                   | 36.051.444    | 40.410.175    |
| <b>Asia ex Japan Equity<br/>USD</b>                       |  |  |                                    |                              |               |               |
| AC  | 1,85 %   |  | 1.354.744,920                      | 68,52                        | 66,85         | 77,69         |
| AC EUR  | 1,86 %   |  | 78.816,486                         | 13,85                        | 13,52         | 15,71         |
| ACO EUR   | 1,88 %   |  | 427.338,597                        | 19,62                        | 19,65         | 24,19         |
| AD  | 1,85 %   |  | 1.302.067,681                      | 60,28                        | 59,02         | 68,59         |
| ADO EUR   | 1,88 %   |  | 26.161,611                         | 18,18                        | 18,27         | 22,49         |
| BC  | 1,10 %   |  | 68.542,866                         | 10,03                        | 9,71          | 11,20         |
| BC EUR**  | -  |  | -                                  | -                            | 11,89         | 13,71         |
| BCO EUR   | 1,13 %   |  | 238.663,484                        | 8,60                         | 8,54          | 10,44         |
| BD  | 1,10 %   |  | 29.278,424                         | 10,50                        | 10,28         | 11,95         |
| BD GBP  | 1,10 %   |  | 26.110,778                         | 21,93                        | 21,47         | 25,18         |
| EC  | 2,36 %   |  | 19.999,841                         | 59,06                        | 57,92         | 67,64         |
| ED  | 2,36 %   |  | 629,616                            | 57,69                        | 56,57         | 66,07         |
| IC  | 1,00 %   |  | 259.823,381                        | 76,75                        | 74,25         | 85,56         |
| ID  | 1,00 %   |  | 466,919                            | 65,66                        | 64,29         | 74,76         |
| J1C   | 0,85 %   |  | 601.304,468                        | 16,52                        | 15,96         | 18,36         |
| XC**  | -  |  | -                                  | -                            | 9,65          | 11,10         |
| ZC  | 0,20 %   |  | 371.691,531                        | 74,12                        | 71,14         | 81,28         |
| ZD  | 0,18 %   |  | 1.027.913,045                      | 62,18                        | 60,93         | 71,05         |
| Gesamtnettovermögen                                       |  |  |                                    | 307.460.692                  | 441.953.669   | 584.891.399   |
| <b>Asia ex Japan Equity Smaller<br/>Companies<br/>USD</b> |  |  |                                    |                              |               |               |
| AC  | 1,85 %   |  | 220.797,276                        | 82,19                        | 70,67         | 83,69         |
| AC EUR  | 1,85 %   |  | 140.421,815                        | 22,54                        | 19,38         | 22,95         |
| AD  | 1,85 %   |  | 756.375,924                        | 73,29                        | 63,58         | 75,29         |
| AD HKD  | 1,85 %   |  | 26.623,149                         | 2,40                         | 2,08          | 2,47          |
| BC  | 1,10 %   |  | 395.479,425                        | 16,78                        | 14,32         | 16,83         |
| BC EUR  | 1,10 %   |  | 185.279,008                        | 15,36                        | 13,11         | 15,41         |
| BC GBP  | 1,10 %   |  | 84.202,792                         | 38,59                        | 32,93         | 38,71         |
| BD  | 1,10 %   |  | 2.749,987                          | 15,09                        | 13,09         | 15,50         |
| BD GBP  | 1,10 %   |  | 18.341,396                         | 35,22                        | 30,55         | 36,19         |
| EC  | 2,36 %   |  | 77.465,018                         | 75,56                        | 65,29         | 77,71         |
| IC  | 1,00 %   |  | 1.118.446,481                      | 93,29                        | 79,54         | 93,40         |
| IC EUR  | 1,00 %   |  | 30.130,747                         | 15,69                        | 13,38         | 15,71         |
| ID  | 1,00 %   |  | 9.104,763                          | 26,27                        | 22,79         | 27,00         |
| J1C   | 0,85 %   |  | 475.000,000                        | 14,28                        | 12,16         | 14,26         |
| XC  | 0,90 %   |  | 12.111.764,960                     | 14,57                        | 12,41         | 14,56         |
| XC EUR**  | -  |  | -                                  | -                            | -             | 18,09         |
| XD  | 0,00 %   |  | 0,883                              | 15,70                        | 13,63         | 16,16         |
| ZC  | 0,21 %   |  | 467.264,254                        | 17,58                        | 14,88         | 17,32         |
| Gesamtnettovermögen                                       |  |  |                                    | 392.631.869                  | 488.947.322   | 758.828.482   |

\* Nettoinventarwert je Anteil mit Swing-Korrektur (siehe Erläuterung 14),

\*\* Die Anteilsklassen sind zum 31. März 2024 inaktiv,

\*\*\* Bis zum 31. Juli 2023 lautete der Name des Teilfonds „Thai Equity“,  
Der Nettoinventarwert je Anteil ist stets in der Währung des Teilfonds angegeben.

# Wichtige Kennzahlen

zum 31. März 2024

| Teilfonds   | Gesamtkostenquote<br>(TER)/synthetische<br>TER |  | Anteile in Umlauf<br>31. März 2024 | Nettoinventarwert je Anteil* |                    |                    |
|---|--|--|------------------------------------|------------------------------|--------------------|--------------------|
|   | 31. März 2024<br>(siehe Erläuterung 15)        |  |                                    | 31. März 2024                | 31. März 2023      | 31. März 2022      |
| <b>Asia Pacific ex Japan Equity High Dividend USD</b> |  |  |                                    |                              |                    |                    |
| AC  | 1,85 %   |  | 490.808,251                        | 30,46                        | 28,80              | 32,67              |
| AM2   | 1,85 %   |  | 6.023.757,385                      | 9,13                         | 8,99               | 10,70              |
| AM2 HKD   | 1,85 %   |  | 21.425.431,763                     | 1,18                         | 1,16               | 1,38               |
| AM30 RMB  | 1,88 %   |  | 3.684.823,821                      | 1,17                         | 1,22               | 1,58               |
| AS  | 1,85 %   |  | 898.569,607                        | 20,59                        | 19,81              | 22,96              |
| BC EUR  | 1,10 %   |  | 500,000                            | 12,00                        | 11,26              | 12,68              |
| BD EUR  | 1,10 %   |  | 6.238,000                          | 12,02                        | 11,61              | 13,55              |
| BS GBP  | 1,10 %   |  | 6.768,529                          | 20,58                        | 19,84              | 22,96              |
| EC  | 2,36 %   |  | 17.295,061                         | 28,07                        | 26,68              | 30,42              |
| IC  | 1,00 %   |  | 828.942,256                        | 30,48                        | 28,58              | 32,15              |
| IC EUR  | 1,00 %   |  | 88.346,369                         | 24,00                        | 22,51              | 25,31              |
| S48M2 SGD   | 1,65 %   |  | 53.864,325                         | 7,85                         | -                  | -                  |
| S9S   | 0,65 %   |  | 58.570,976                         | 12,79                        | 12,27              | 14,19              |
| XC  | 0,87 %   |  | 0,709                              | 11,70                        | 10,92              | 12,27              |
| XD  | 0,87 %   |  | 4.283.415,000                      | 11,44                        | 11,10              | 12,97              |
| XD EUR  | 0,88 %   |  | 1.148.646,637                      | 11,11                        | 10,79              | 12,60              |
| XM2**   | -  |  | -                                  | -                            | 7,98               | 9,40               |
| ZM2**   | -  |  | -                                  | -                            | 8,46               | 9,91               |
| ZS  | 0,17 %   |  | 2.799.123,027                      | 21,56                        | 20,68              | 23,89              |
| <b>Gesamtnettovermögen</b>                            |  |  |                                    | <b>269.983.224</b>           | <b>413.697.275</b> | <b>423.674.273</b> |
| <b>China A-Shares Equity USD</b>                      |  |  |                                    |                              |                    |                    |
| AC  | 1,90 %   |  | 43.111,877                         | 10,14                        | 11,05              | 12,08              |
| BC  | 1,15 %   |  | 100,000                            | 10,49                        | 11,34              | 12,31              |
| BD  | 1,15 %   |  | 8.690,000                          | 9,42                         | 10,26              | 11,20              |
| XC  | 0,99 %   |  | 100,000                            | 10,58                        | 11,42              | 12,37              |
| XC EUR  | 0,93 %   |  | 100,000                            | 11,65                        | 12,58              | 13,61              |
| ZC  | 0,30 %   |  | 2.127.620,231                      | 10,90                        | 11,69              | 12,58              |
| <b>Gesamtnettovermögen</b>                            |  |  |                                    | <b>23.715.001</b>            | <b>20.952.438</b>  | <b>23.132.398</b>  |
| <b>Chinese Equity USD</b>                             |  |  |                                    |                              |                    |                    |
| AC  | 1,90 %   |  | 1.151.897,570                      | 88,42                        | 102,97             | 116,21             |
| AC EUR  | 1,90 %   |  | 34.869,591                         | 15,89                        | 18,51              | 20,89              |
| AC GBP  | 1,90 %   |  | 25.691,612                         | 20,81                        | 24,23              | 27,35              |
| AC HKD  | 1,91 %   |  | 8.217.409,024                      | 0,67                         | 0,78               | 0,88               |
| AD  | 1,90 %   |  | 4.946.189,521                      | 80,64                        | 95,01              | 107,23             |
| AD GBP  | 1,90 %   |  | 2.471,498                          | 19,63                        | 23,13              | 26,10              |
| AD HKD  | 1,90 %   |  | 3.603.560,662                      | 1,28                         | 1,51               | 1,71               |
| BC  | 1,15 %   |  | 107.560,848                        | 12,23                        | 14,13              | 15,83              |
| BC GBP  | 1,15 %   |  | 45.048,894                         | 20,93                        | 24,19              | 27,10              |
| BD  | 1,15 %   |  | 177.826,560                        | 10,74                        | 12,67              | 14,28              |
| BD GBP  | 1,15 %   |  | 14.534,039                         | 18,78                        | 22,16              | 24,98              |
| EC  | 2,41 %   |  | 50.946,642                         | 80,39                        | 94,09              | 106,71             |
| IC  | 1,05 %   |  | 73.845,220                         | 103,64                       | 119,67             | 133,91             |
| ID  | 1,05 %   |  | 1.863,276                          | 84,33                        | 99,50              | 112,19             |
| J1C   | 0,90 %   |  | 2.544.542,861                      | 7,94                         | 9,15               | -                  |
| XC**  | -  |  | -                                  | -                            | -                  | 12,66              |
| XC EUR  | 0,88 %   |  | 225.357,291                        | 11,01                        | -                  | -                  |
| ZC  | 0,15 %   |  | 38.269,639                         | 94,53                        | 108,19             | 119,96             |
| ZD  | 0,14 %   |  | 314.105,110                        | 85,24                        | 100,75             | 113,86             |
| <b>Gesamtnettovermögen</b>                            |  |  |                                    | <b>581.414.749</b>           | <b>761.626.018</b> | <b>890.685.985</b> |
| <b>Euroland Equity Smaller Companies EUR</b>          |  |  |                                    |                              |                    |                    |
| AC  | 1,85 %   |  | 571.437,151                        | 75,65                        | 71,14              | 79,02              |
| ACH USD   | 1,88 %   |  | 3.106,933                          | 12,88                        | 11,81              | 12,36              |
| AD  | 1,85 %   |  | 45.343,408                         | 70,79                        | 67,32              | 74,77              |
| BC  | 1,10 %   |  | 51.102,744                         | 11,62                        | 10,85              | 11,96              |
| EC  | 2,36 %   |  | 5.293,206                          | 69,45                        | 65,63              | 73,26              |
| IC  | 1,00 %   |  | 132.907,577                        | 87,92                        | 81,98              | 90,29              |
| ID**  | -  |  | -                                  | -                            | 12,82              | 14,50              |
| XC**  | -  |  | -                                  | -                            | 14,27              | 15,69              |
| ZC  | 0,18 %   |  | 419.133,603                        | 106,41                       | 98,42              | 107,47             |
| <b>Gesamtnettovermögen</b>                            |  |  |                                    | <b>103.726.044</b>           | <b>109.218.855</b> | <b>153.070.988</b> |

\* Nettoinventarwert je Anteil mit Swing-Korrektur (siehe Erläuterung 14),

\*\* Die Anteilsklassen sind zum 31. März 2024 inaktiv,

Der Nettoinventarwert je Anteil ist stets in der Währung des Teilfonds angegeben.

# Wichtige Kennzahlen

zum 31. März 2024

| Teilfonds                                     | Gesamtkostenquote<br>(TER)/synthetische<br>TER |  | Anteile in Umlauf<br>31. März 2024 | Nettoinventarwert je Anteil* |                    |                    |
|---|--|--|------------------------------------|------------------------------|--------------------|--------------------|
|   | 31. März 2024<br>(siehe Erläuterung 15)        |  |                                    | 31. März 2024                | 31. März 2023      | 31. März 2022      |
| <b>Euroland Growth<br/>EUR</b>                |  |  |                                    |                              |                    |                    |
| AC  | 1,85 %   |  | 4.682.175,140                      | 24,26                        | 22,07              | 21,32              |
| BC  | 1,10 %   |  | 762.191,348                        | 13,33                        | 12,04              | 11,54              |
| EC  | 2,36 %   |  | 5.204,239                          | 19,64                        | 17,95              | 17,43              |
| IC  | 1,00 %   |  | 419.237,036                        | 27,41                        | 24,72              | 23,68              |
| M1C   | 1,60 %   |  | 5.491,582                          | 25,12                        | 22,79              | 21,97              |
| M1D   | 1,60 %   |  | 154.793,089                        | 21,23                        | 19,29              | 18,59              |
| XC  | 0,84 %   |  | 11.802,917                         | 12,80                        | 11,53              | 11,03              |
| ZC  | 0,14 %   |  | 2.832.874,035                      | 21,52                        | 19,24              | 18,27              |
| <b>Gesamtnettovermögen</b>                    |  |  |                                    | <b>199.893.545</b>           | <b>287.493.353</b> | <b>247.883.485</b> |
| <b>Euroland Value<br/>EUR</b>                 |  |  |                                    |                              |                    |                    |
| AC  | 1,85 %   |  | 1.367.514,953                      | 58,32                        | 49,32              | 47,29              |
| ACH USD                                       | 1,88 %   |  | 3.026,720                          | 18,14                        | 14,97              | 13,56              |
| AD  | 1,85 %   |  | 393.814,195                        | 47,97                        | 41,23              | 39,75              |
| ADH USD                                       | 1,88 %   |  | 184.837,031                        | 14,30                        | 11,98              | 10,89              |
| BC  | 1,10 %   |  | 299.427,722                        | 14,34                        | 12,04              | 11,45              |
| BD  | 1,10 %   |  | 2.803,108                          | 11,40                        | -                  | 11,08              |
| EC  | 2,36 %   |  | 17.037,288                         | 53,49                        | 45,46              | 43,80              |
| ED  | 2,36 %   |  | 1.440,413                          | 47,45                        | 40,77              | 39,28              |
| IC  | 1,00 %   |  | 1.104.802,948                      | 67,57                        | 56,66              | 53,87              |
| ID**  | -  |  | -                                  | -                            | -                  | 46,77              |
| XC  | 0,75 %   |  | 1.926.289,948                      | 18,96                        | 15,86              | 15,03              |
| ZC  | 0,14 %   |  | 380.634,284                        | 82,32                        | 68,44              | 64,49              |
| ZD  | 0,16 %   |  | 52.471,730                         | 52,88                        | 45,41              | 43,81              |
| <b>Gesamtnettovermögen</b>                    |  |  |                                    | <b>251.927.005</b>           | <b>298.987.918</b> | <b>523.701.679</b> |
| <b>Europe Value<br/>EUR</b>                   |  |  |                                    |                              |                    |                    |
| AC  | 1,85 %   |  | 174.246,957                        | 59,34                        | 52,96              | 50,19              |
| AD  | 1,85 %   |  | 20.370,086                         | 46,55                        | 42,33              | 40,64              |
| EC  | 2,36 %   |  | 1.470,138                          | 52,42                        | 47,02              | 44,78              |
| ED  | 2,36 %   |  | 76.612,140                         | 45,80                        | 41,65              | 39,96              |
| IC  | 1,00 %   |  | 6.292,024                          | 68,05                        | 60,23              | 56,60              |
| ID  | 1,00 %   |  | 4.045,154                          | 10,71                        | 9,73               | 9,36               |
| PD  | 1,35 %   |  | 845.857,428                        | 46,04                        | 41,85              | 40,21              |
| ZC  | 0,20 %   |  | 262.375,471                        | 13,11                        | 11,51              | 10,73              |
| ZD  | 0,20 %   |  | 84.038,880                         | 47,38                        | 43,07              | 41,45              |
| <b>Gesamtnettovermögen</b>                    |  |  |                                    | <b>61.706.710</b>            | <b>78.922.996</b>  | <b>80.552.228</b>  |
| <b>Global Emerging Markets Equity<br/>USD</b> |  |  |                                    |                              |                    |                    |
| AC  | 1,90 %   |  | 12.737.865,717                     | 18,41                        | 17,34              | 21,24              |
| AC EUR  | 1,90 %   |  | 23.608,496                         | 17,44                        | 16,44              | 20,12              |
| AC GBP  | 1,90 %   |  | 11.909,708                         | 18,51                        | 17,44              | 21,36              |
| AD  | 1,90 %   |  | 608.336,350                        | 16,42                        | 15,53              | 19,02              |
| AD GBP  | 1,90 %   |  | 1.761,406                          | 17,16                        | 16,23              | 19,88              |
| BC  | 1,15 %   |  | 185.649,365                        | 10,96                        | 10,25              | 12,46              |
| BD  | 1,15 %   |  | 2.522,739                          | 10,72                        | -                  | -                  |
| BC GBP  | 1,15 %   |  | 26.001,171                         | 23,07                        | 21,58              | 26,22              |
| BD GBP  | 1,15 %   |  | 4.416,844                          | 17,59                        | 16,64              | 20,42              |
| EC  | 2,41 %   |  | 80.431,269                         | 16,31                        | 15,44              | 19,00              |
| ED  | 2,41 %   |  | 780,985                            | 15,56                        | 14,73              | 18,13              |
| IC  | 1,05 %   |  | 738.010,493                        | 21,16                        | 19,77              | 24,01              |
| PC  | 1,40 %   |  | 1.551.217,510                      | 13,36                        | 12,53              | 15,26              |
| PD  | 1,40 %   |  | 77.660,089                         | 11,33                        | 10,72              | 13,14              |
| S1D   | 0,85 %   |  | 462.261,672                        | 8,14                         | 7,70               | 9,46               |
| XC  | 0,87 %   |  | 336.552,869                        | 12,85                        | 11,99              | 14,53              |
| XC EUR  | 0,86 %   |  | 2.801.567,381                      | 10,20                        | 9,52               | -                  |
| ZC  | 0,12 %   |  | 3.640.000,000                      | 11,00                        | 10,18              | -                  |
| ZD  | 0,16 %   |  | 302.485,787                        | 16,77                        | 15,87              | 19,54              |
| <b>Gesamtnettovermögen</b>                    |  |  |                                    | <b>368.138.091</b>           | <b>401.621.285</b> | <b>349.052.270</b> |

\* Nettoinventarwert je Anteil mit Swing-Korrektur (siehe Erläuterung 14),

\*\* Die Anteilsklassen sind zum 31. März 2024 inaktiv,

Der Nettoinventarwert je Anteil ist stets in der Währung des Teilfonds angegeben.

# Wichtige Kennzahlen

zum 31. März 2024

| Teilfonds                                   | Gesamtkostenquote<br>(TER)/synthetische<br>TER |  | Anteile in Umlauf<br>31. März 2024 | Nettoinventarwert je Anteil* |               |               |
|---|--|--|------------------------------------|------------------------------|---------------|---------------|
|   | 31. März 2024<br>(siehe Erläuterung 15)        |  |                                    | 31. März 2024                | 31. März 2023 | 31. März 2022 |
| Global Equity Circular Economy<br>USD       |  |  |                                    |                              |               |               |
| AC  | 1,85 %   |  | 212.350,630                        | 13,63                        | 11,69         | -             |
| AC EUR                                      | 1,85 %   |  | 1.119.615,582                      | 14,26                        | 12,23         | -             |
| IC  | 1,00 %   |  | 500,000                            | 13,84                        | 11,77         | -             |
| XC  | 0,80 %   |  | 500,000                            | 13,89                        | 11,79         | -             |
| ZC  | 0,25 %   |  | 6.701.915,999                      | 14,03                        | 11,84         | -             |
| Gesamtnettovermögen                         |  |  |                                    | 112.865.607                  | 29.600.886    | -             |
| Global Equity Climate Change<br>USD         |  |  |                                    |                              |               |               |
| AC  | 1,85 %   |  | 8.122.880,330                      | 13,05                        | 12,29         | 13,66         |
| AC EUR                                      | 1,85 %   |  | 2.286,509                          | 9,58                         | 9,02          | 10,02         |
| AC GBP                                      | 1,85 %   |  | 2.411,577                          | 11,94                        | 11,24         | 12,50         |
| ACH AUD                                     | 1,88 %   |  | 6.094,496                          | 5,40                         | 5,35          | 6,89          |
| ACH EUR                                     | 1,88 %   |  | 4.248,535                          | 8,83                         | 8,57          | 10,18         |
| ACH GBP                                     | 1,88 %   |  | 29.638,448                         | 10,68                        | 9,94          | 12,12         |
| ACH HKD                                     | 1,84 %   |  | 776,420                            | 1,11                         | 1,05          | 1,18          |
| ACH SGD                                     | 1,88 %   |  | 65.366,463                         | 6,31                         | 6,16          | 6,83          |
| AD  | 1,85 %   |  | 2.719.893,479                      | 12,55                        | 11,82         | 13,14         |
| AD EUR                                      | 1,85 %   |  | 1.800,000                          | 10,96                        | 10,32         | -             |
| EC  | 2,36 %   |  | 197.409,815                        | 12,04                        | 11,39         | 12,73         |
| IC  | 1,00 %   |  | 111.316,343                        | 9,99                         | 9,33          | 10,28         |
| IC GBP                                      | 1,05 %   |  | 81,140                             | 13,30                        | 12,43         | -             |
| ICH EUR**                                   | -  |  | -                                  | -                            | 8,23          | 9,70          |
| ID GBP                                      | 1,05 %   |  | 81,233                             | 13,28                        | 12,43         | -             |
| JC  | 0,65 %   |  | 1.707.448,416                      | 9,44                         | 8,78          | 9,64          |
| XC  | 0,78 %   |  | 168.963,746                        | 9,15                         | 8,52          | 9,37          |
| ZQ1   | 0,13 %   |  | 9.634.805,887                      | 15,42                        | 14,43         | 15,97         |
| Gesamtnettovermögen                         |  |  |                                    | 310.744.251                  | 297.237.965   | 344.903.678   |
| Global Equity Sustainable Healthcare<br>USD |  |  |                                    |                              |               |               |
| AC  | 1,85 %   |  | 1.763.599,450                      | 10,70                        | 8,84          | 9,82          |
| AC EUR                                      | 1,85 %   |  | 3.903.614,576                      | 12,82                        | 10,58         | 11,77         |
| AC HKD                                      | 1,85 %   |  | 3.671.586,626                      | 1,35                         | 1,11          | 1,24          |
| ACO AUD                                     | 1,87 %   |  | 477.371,687                        | 6,61                         | 5,72          | 7,31          |
| ACO EUR                                     | 1,88 %   |  | 35.078,088                         | 10,80                        | 9,16          | 10,81         |
| ACO GBP                                     | 1,88 %   |  | 51.599,350                         | 13,06                        | 10,64         | 12,86         |
| ACO RMB**                                   | -  |  | -                                  | -                            | -             | 1,54          |
| ACO SGD                                     | 1,88 %   |  | 86.748,607                         | 7,67                         | 6,55          | 7,24          |
| AD  | 1,85 %   |  | 18.671,746                         | 13,21                        | -             | -             |
| ADO GBP                                     | 1,87 %   |  | 2.249,404                          | 17,66                        | 14,39         | -             |
| BC  | 1,10 %   |  | 195.610,496                        | 10,45                        | 8,57          | 9,45          |
| BCO GBP                                     | 1,13 %   |  | 14.530,478                         | 14,38                        | 11,64         | 13,97         |
| BD EUR                                      | 1,10 %   |  | 69.459,648                         | 12,67                        | 10,38         | 11,46         |
| BD GBP                                      | 1,06 %   |  | 74,040                             | 16,57                        | -             | -             |
| IC  | 1,00 %   |  | 273.860,008                        | 10,95                        | 8,96          | 9,88          |
| JD  | 0,75 %   |  | 158.943,666                        | 12,38                        | 10,11         | -             |
| JD EUR                                      | 0,75 %   |  | 27.071,505                         | 13,35                        | 10,90         | -             |
| JD GBP                                      | 0,75 %   |  | 7.565.786,391                      | 16,08                        | 13,13         | -             |
| XC EUR                                      | 0,75 %   |  | 1.849.090,910                      | 12,99                        | 10,61         | 11,67         |
| XCO EUR                                     | 0,83 %   |  | 809.156,545                        | 11,99                        | -             | -             |
| XD  | 0,78 %   |  | 102.868,000                        | 11,93                        | 9,75          | 10,72         |
| ZC  | 0,14 %   |  | 4.824.600,111                      | 12,06                        | 9,08          | 9,93          |
| Gesamtnettovermögen                         |  |  |                                    | 302.248.142                  | 136.633.554   | 121.705.058   |

\* Nettoinventarwert je Anteil mit Swing-Korrektur (siehe Erläuterung 14),

\*\* Die Anteilsklassen sind zum 31. März 2024 inaktiv,

Der Nettoinventarwert je Anteil ist stets in der Währung des Teilfonds angegeben.



# Wichtige Kennzahlen

zum 31. März 2024

| Teilfonds                               | Gesamtkostenquote<br>(TER)/synthetische<br>TER |  | Anteile in Umlauf<br>31. März 2024 | Nettoinventarwert je Anteil* |               |               |
|---|--|--|------------------------------------|------------------------------|---------------|---------------|
|   | 31. März 2024<br>(siehe Erläuterung 15)        |  |                                    | 31. März 2024                | 31. März 2023 | 31. März 2022 |
| Global Infrastructure Equity<br>USD     |  |  |                                    |                              |               |               |
| AC                                      | 1,85 %   |  | 305.476,465                        | 10,12                        | 9,54          | -             |
| AC EUR                                  | 1,85 %   |  | 93.101,911                         | 11,57                        | -             | -             |
| AD                                      | 1,86 %   |  | 100,000                            | 10,49                        | -             | -             |
| AM2                                     | 1,85 %   |  | 98.892,711                         | 10,54                        | 10,33         | -             |
| AM2 HKD                                 | 1,86 %   |  | 120.688,574                        | 1,36                         | 1,34          | -             |
| AM30 AUD                                | 1,88 %   |  | 28.007,316                         | 6,83                         | 6,94          | -             |
| AM30 EUR                                | 1,88 %   |  | 6.664,976                          | 11,36                        | 11,25         | -             |
| AM30 GBP                                | 1,88 %   |  | 8.542,574                          | 13,29                        | 12,81         | -             |
| AM30 RMB                                | 1,88 %   |  | 1.657,402                          | 1,44                         | 1,50          | -             |
| AMFLX                                   | 1,85 %   |  | 8.418,484                          | 116,49                       | 116,09        | -             |
| AMFLX HKD                               | 1,85 %   |  | 1.129,506                          | 13,36                        | 13,31         | -             |
| AMFLXO AUD                              | 1,86 %   |  | 15,757                             | 66,89                        | 69,05         | -             |
| AMFLXO EUR                              | 1,83 %   |  | 9,811                              | 111,26                       | 112,03        | -             |
| AMFLXO GBP                              | 1,84 %   |  | 8,697                              | 130,12                       | 127,53        | -             |
| AMFLXO RMB                              | 1,88 %   |  | 50.761,858                         | 14,09                        | 14,90         | -             |
| BC                                      | 1,10 %   |  | 481.403,203                        | 10,70                        | 10,01         | -             |
| BC EUR                                  | 1,10 %   |  | 7.750,938                          | 11,46                        | 10,72         | -             |
| BC GBP                                  | 1,10 %   |  | 526.091,783                        | 12,86                        | 12,02         | -             |
| BD                                      | 1,10 %   |  | 283.170,259                        | 10,57                        | 9,90          | -             |
| S46C                                    | 0,56 %   |  | 3.690.716,887                      | 10,77                        | 10,01         | -             |
| S46CO EUR                               | 0,50 %   |  | 1.202.931,661                      | 11,35                        | 10,86         | -             |
| S46CO GBP                               | 0,56 %   |  | 71.475,485                         | 13,55                        | 12,46         | -             |
| ZBFIX8.5 JPY                            | 0,25 %   |  | 1.798,300                          | 72,37                        | 73,03         | -             |
| ZC                                      | 0,16 %   |  | 8.320.156,103                      | 11,36                        | -             | -             |
| ZD                                      | 0,13 %   |  | 47.633.938,082                     | 10,40                        | 9,89          | -             |
| ZQ1                                     | 0,12 %   |  | 4.497.294,694                      | 10,23                        | 9,80          | 10,13         |
| ZQ1 GBP                                 | 0,10 %   |  | 12.971.674,849                     | 13,13                        | 12,58         | -             |
| Gesamtneuvermögen                       |  |  |                                    | 883.280.410                  | 651.906.409   | 27.011.621    |
| Global Real Estate Equity<br>USD        |  |  |                                    |                              |               |               |
| AC                                      | 1,90 %   |  | 148.683,624                        | 9,75                         | 9,38          | 12,68         |
| AC EUR                                  | 1,90 %   |  | 576.175,007                        | 11,16                        | 10,74         | 14,51         |
| AD                                      | 1,90 %   |  | 10.278,264                         | 8,96                         | 8,75          | 11,89         |
| AM2                                     | 1,90 %   |  | 89.657,031                         | 7,50                         | 7,52          | 10,56         |
| AM30 SGD                                | 1,93 %   |  | 22.537,753                         | 5,32                         | 5,44          | 7,57          |
| BCO GBP**                               | -  |  | -                                  | -                            | 9,28          | 13,62         |
| BQ1                                     | 1,15 %   |  | 10.188,175                         | 10,31                        | 10,16         | 14,10         |
| ID                                      | 1,00 %   |  | 20.630,688                         | 9,01                         | 8,81          | 11,99         |
| ZBFIX8.5 JPY                            | 0,20 %   |  | 1.598,250                          | 57,07                        | 58,81         | 85,16         |
| ZC                                      | 0,12 %   |  | 2.878.824,046                      | 11,45                        | 10,82         | 14,36         |
| ZD                                      | 0,12 %   |  | 7.446.263,045                      | 9,06                         | 8,87          | 12,12         |
| ZM2                                     | 0,15 %   |  | 107.767,047                        | 8,69                         | 8,55          | 11,80         |
| ZQ1                                     | 0,12 %   |  | 57.821.418,024                     | 9,22                         | 8,99          | 12,35         |
| Gesamtneuvermögen                       |  |  |                                    | 643.595.783                  | 690.088.043   | 1.545.270.459 |
| Global Lower Carbon Equity<br>USD       |  |  |                                    |                              |               |               |
| AC                                      | 1,15 %   |  | 609.459,318                        | 17,14                        | 13,82         | 15,10         |
| AC EUR                                  | 1,15 %   |  | 8.362.409,881                      | 19,47                        | 15,70         | 17,15         |
| AD                                      | 1,15 %   |  | 975.309,883                        | 16,46                        | 13,40         | 14,73         |
| AD HKD                                  | 1,15 %   |  | 1.586.398,471                      | 2,02                         | 1,65          | 1,81          |
| BC                                      | 0,75 %   |  | 35.176,028                         | 19,31                        | 15,51         | 16,88         |
| BC GBP                                  | 0,75 %   |  | 64.865,689                         | 19,21                        | 15,43         | 16,79         |
| EC                                      | 1,45 %   |  | 952,866                            | 11,05                        | 8,93          | 9,79          |
| ID                                      | 0,65 %   |  | 222.887,975                        | 17,91                        | 14,58         | 16,04         |
| XC                                      | 0,55 %   |  | 500,000                            | 17,82                        | 14,28         | 15,52         |
| ZC**                                    | -  |  | -                                  | -                            | -             | 15,48         |
| ZQ1                                     | 0,13 %   |  | 10.874.656,144                     | 16,03                        | 13,06         | 14,42         |
| Gesamtneuvermögen                       |  |  |                                    | 372.701.620                  | 270.407.334   | 283.058.434   |
| Global Sustainable Equity Income<br>USD |  |  |                                    |                              |               |               |
| AD                                      | 0,87 %   |  | 101,305                            | 13,08                        | 10,84         | -             |
| ZBFIX8.5 JPY                            | 0,23 %   |  | 27.572,586                         | 87,12                        | 77,04         | -             |
| ZM1                                     | 0,16 %   |  | 1.567.482,000                      | 13,81                        | 11,49         | -             |
| ZQ1                                     | 0,17 %   |  | 19.055.844,783                     | 11,67                        | 9,71          | -             |
| Gesamtneuvermögen                       |  |  |                                    | 246.473.431                  | 150.650.459   | -             |

\* Nettoinventarwert je Anteil mit Swing-Korrektur (siehe Erläuterung 14),

\*\* Die Anteilsklassen sind zum 31. März 2024 inaktiv,

Der Nettoinventarwert je Anteil ist stets in der Währung des Teilfonds angegeben.

# Wichtige Kennzahlen

zum 31. März 2024

| Teilfonds                           | Gesamtkostenquote<br>(TER)/synthetische<br>TER |  | Anteile in Umlauf<br>31. März 2024 | Nettoinventarwert je Anteil* |               |               |
|-------------------------------------|--|--|------------------------------------|------------------------------|---------------|---------------|
|                                     | 31. März 2024<br>(siehe Erläuterung 15)        |  |                                    | 31. März 2024                | 31. März 2023 | 31. März 2022 |
| Global Sustainable Long Term        |  |  |                                    |                              |               |               |
| Dividend                            |  |  |                                    |                              |               |               |
| USD                                 |  |  |                                    |                              |               |               |
| AC                                  | 1,85 %   |  | 75.299,629                         | 18,62                        | 15,44         | 15,86         |
| AC EUR                              | 1,85 %   |  | 598.736,979                        | 19,48                        | 16,15         | 16,59         |
| AM2                                 | 1,85 %   |  | 1.527.769,381                      | 14,63                        | 12,38         | 13,02         |
| AM2 HKD                             | 1,85 %   |  | 4.880.575,507                      | 1,89                         | 1,60          | 1,68          |
| AMFLX                               | 1,80 %   |  | 10,713                             | 141,12                       | 123,70        | -             |
| AQ2                                 | 1,84 %   |  | 3,420                              | 14,65                        | 12,32         | 12,98         |
| EQ2                                 | 2,36 %   |  | 2.240,230                          | 13,95                        | 11,86         | 12,55         |
| IC                                  | 1,06 %   |  | 100,000                            | 11,31                        | 9,30          | 9,48          |
| IQ                                  | 1,06 %   |  | 101,702                            | 11,10                        | 9,20          | 9,46          |
| XC                                  | 0,80 %   |  | 500,000                            | 20,40                        | 16,73         | 17,01         |
| ZBFIX8.5 JPY**                      | -  |  | -                                  | -                            | -             | 95,81         |
| ZM2                                 | 0,25 %   |  | 233.561,136                        | 15,12                        | 12,59         | 13,04         |
| Gesamtnettvermögen                  |  |  |                                    | 48.196.854                   | 23.651.672    | 56.146.776    |
| Global Sustainable Long Term Equity |  |  |                                    |                              |               |               |
| USD                                 |  |  |                                    |                              |               |               |
| AC                                  | 1,85 %   |  | 35.813,129                         | 13,96                        | 11,34         | -             |
| AC GBP                              | 1,85 %   |  | 16.095,178                         | 15,73                        | 12,78         | -             |
| AD                                  | 1,86 %   |  | 500,000                            | 13,95                        | 11,34         | -             |
| BC                                  | 1,11 %   |  | 500,000                            | 14,12                        | 11,39         | -             |
| BC GBP                              | 1,11 %   |  | 78,150                             | 12,63                        | -             | -             |
| BD                                  | 1,11 %   |  | 500,173                            | 14,11                        | 11,39         | -             |
| BD GBP                              | 1,11 %   |  | 78,150                             | 12,63                        | -             | -             |
| IC                                  | 1,00 %   |  | 500,000                            | 14,14                        | 11,40         | -             |
| ID                                  | 1,00 %   |  | 500,403                            | 14,13                        | 11,40         | -             |
| ZC                                  | 0,25 %   |  | 1.924.884,000                      | 14,31                        | 11,45         | -             |
| ZQ1                                 | 0,21 %   |  | 7.072.313,555                      | 11,35                        | -             | -             |
| Gesamtnettvermögen                  |  |  |                                    | 108.633.837                  | 11.496.568    | -             |
| Hong Kong Equity                    |  |  |                                    |                              |               |               |
| USD                                 |  |  |                                    |                              |               |               |
| AC                                  | 1,85 %   |  | 338.636,521                        | 112,79                       | 136,91        | 149,36        |
| AC HKD                              | 1,85 %   |  | 22.952.441,358                     | 0,72                         | 0,87          | 0,95          |
| AD                                  | 1,85 %   |  | 77.350,731                         | 92,96                        | 113,94        | 124,31        |
| AD HKD                              | 1,85 %   |  | 201.287,865                        | 1,07                         | 1,31          | 1,43          |
| BD GBP                              | 1,10 %   |  | 7.738,567                          | 13,16                        | 16,14         | 17,64         |
| EC                                  | 2,36 %   |  | 9.185,092                          | 103,66                       | 126,45        | 138,64        |
| IC                                  | 1,00 %   |  | 21.132,213                         | 129,98                       | 156,45        | 169,22        |
| PD                                  | 1,35 %   |  | 419.270,944                        | 91,95                        | 112,78        | 123,16        |
| ZD                                  | 0,19 %   |  | 214.801,418                        | 97,47                        | 119,73        | 131,05        |
| Gesamtnettvermögen                  |  |  |                                    | 125.396.814                  | 137.904.206   | 110.934.711   |
| BRIC Equity                         |  |  |                                    |                              |               |               |
| USD                                 |  |  |                                    |                              |               |               |
| AC                                  | 1,85 %   |  | 693.987,132                        | 22,59                        | 21,37         | 25,65         |
| AC GBP                              | 1,85 %   |  | 20.133,076                         | 16,63                        | 15,73         | 18,89         |
| AC HKD                              | 1,85 %   |  | 861.326,621                        | 1,08                         | 1,02          | 1,23          |
| AD                                  | 1,85 %   |  | 34.724,117                         | 18,89                        | 18,31         | 22,46         |
| AD GBP                              | 1,85 %   |  | 186,564                            | 19,19                        | 18,61         | 22,82         |
| BC GBP                              | 1,10 %   |  | 33.201,133                         | 20,45                        | 19,20         | 22,87         |
| BD GBP                              | 1,10 %   |  | 4.464,680                          | 15,52                        | 15,06         | 18,53         |
| EC                                  | 2,36 %   |  | 3.066,943                          | 20,72                        | 19,69         | 23,75         |
| IC                                  | 1,00 %   |  | 8.922,307                          | 25,52                        | 23,93         | 28,48         |
| IC EUR                              | 1,00 %   |  | 31.826,535                         | 14,41                        | 13,52         | 16,09         |
| J1C**                               | -  |  | -                                  | -                            | -             | 21,70         |
| L1C                                 | 0,78 %   |  | 55,000                             | 26,23                        | 24,54         | 29,14         |
| M1C                                 | 1,35 %   |  | 56.648,046                         | 25,54                        | 24,04         | 28,71         |
| M2C                                 | 1,35 %   |  | 2.514.209,688                      | 24,56                        | 23,11         | 27,61         |
| M2D                                 | 1,35 %   |  | 995.350,432                        | 19,24                        | 18,66         | 22,94         |
| Gesamtnettvermögen                  |  |  |                                    | 101.452.411                  | 112.091.346   | 196.525.505   |

\* Nettoinventarwert je Anteil mit Swing-Korrektur (siehe Erläuterung 14),

\*\* Die Anteilsklassen sind zum 31. März 2024 inaktiv,

Der Nettoinventarwert je Anteil ist stets in der Währung des Teilfonds angegeben.

# Wichtige Kennzahlen

zum 31. März 2024

| Teilfonds                                   | Gesamtkostenquote<br>(TER)/synthetische TER<br>31. März 2024<br>(siehe Erläuterung 15) |               | Anteile in Umlauf<br>31. März 2024 | Nettoinventarwert je Anteil* |                    |                    |
|---|--|---------------|------------------------------------|------------------------------|--------------------|--------------------|
|   |  |               |                                    | 31. März 2024                | 31. März 2023      | 31. März 2022      |
| <b>BRIC Markets Equity USD</b>              |  |               |                                    |                              |                    |                    |
| AC  | 1,85 %   | 1.828.816,615 |                                    | 15,58                        | 14,74              | 17,72              |
| AD  | 1,85 %   | 643.823,599   |                                    | 13,09                        | 12,69              | 15,58              |
| BD  | 1,10 %   | 21.834,898    |                                    | 10,66                        | 10,35              | 12,74              |
| EC  | 2,36 %   | 93.675,163    |                                    | 14,25                        | 13,55              | 16,38              |
| IC  | 1,00 %   | 20.406,516    |                                    | 18,07                        | 16,96              | 20,21              |
| J1C   | 0,85 %   | 71.939,962    |                                    | 18,60                        | 17,43              | 20,74              |
| <b>Gesamtnettovermögen</b>                  |  |               |                                    | <b>40.191.911</b>            | <b>42.001.466</b>  | <b>86.965.266</b>  |
| <b>Frontier Markets USD</b>                 |  |               |                                    |                              |                    |                    |
| AC  | 2,26 %   | 232.885,009   |                                    | 181,80                       | 133,93             | 143,57             |
| AC EUR                                      | 2,25 %   | 898.674,815   |                                    | 34,52                        | 25,43              | 27,26              |
| AD  | 2,25 %   | 8.530,259     |                                    | 165,92                       | 123,91             | 133,67             |
| AD EUR                                      | 2,25 %   | 57.008,387    |                                    | 23,51                        | 17,55              | 19,02              |
| BC  | 1,75 %   | 275.504,615   |                                    | 21,18                        | 15,53              | 16,56              |
| BC GBP                                      | 1,75 %   | 150.727,916   |                                    | 37,69                        | 27,63              | 29,47              |
| EC  | 2,76 %   | 116.375,397   |                                    | 23,47                        | 17,38              | 18,72              |
| EC EUR                                      | 2,76 %   | 249.325,888   |                                    | 26,55                        | 19,65              | 21,17              |
| IC  | 1,65 %   | 388.805,748   |                                    | 277,14                       | 202,95             | 216,26             |
| IC EUR                                      | 1,65 %   | 393.421,170   |                                    | 34,08                        | 24,95              | 26,59              |
| IC GBP**                                    | -  | -             |                                    | -                            | 30,85              | 32,87              |
| ID  | 1,65 %   | 262.108,249   |                                    | 233,04                       | 174,01             | 187,76             |
| XC  | 1,28 %   | 1.886.117,688 |                                    | 22,36                        | 16,32              | 17,32              |
| XD  | 1,29 %   | 5.292.986,778 |                                    | 19,68                        | 14,70              | 15,86              |
| ZC  | 0,30 %   | 1.033.883,000 |                                    | 11,23                        | 8,11               | 8,59               |
| ZD  | 0,29 %   | 505.813,459   |                                    | 29,79                        | 22,24              | 24,02              |
| <b>Gesamtnettovermögen</b>                  |  |               |                                    | <b>452.235.342</b>           | <b>235.789.493</b> | <b>237.399.268</b> |
| <b>Global Equity Volatility Focused USD</b> |  |               |                                    |                              |                    |                    |
| AC  | 1,15 %   | 135.401,818   |                                    | 17,83                        | 15,12              | 16,19              |
| AC EUR                                      | 1,15 %   | 2.999.392,943 |                                    | 20,10                        | 17,04              | 18,25              |
| ACO AUD                                     | 1,18 %   | 21.612,443    |                                    | 10,37                        | 9,20               | 11,32              |
| ACO EUR                                     | 1,18 %   | 17.577,765    |                                    | 15,56                        | 13,55              | 15,41              |
| ACO SGD                                     | 1,18 %   | 311.260,608   |                                    | 12,35                        | 10,83              | 11,52              |
| AM2   | 1,15 %   | 2.143.192,485 |                                    | 13,66                        | 11,88              | 13,10              |
| AM2 HKD                                     | 1,15 %   | 8.420.428,478 |                                    | 1,76                         | 1,53               | 1,69               |
| AM30 AUD                                    | 1,18 %   | 585.924,462   |                                    | 8,21                         | 7,37               | 9,26               |
| AM30 CAD                                    | 1,18 %   | 386.243,524   |                                    | 9,46                         | 8,25               | 9,96               |
| AM30 EUR                                    | 1,18 %   | 104.331,853   |                                    | 14,00                        | 12,28              | 14,04              |
| AM30 RMB                                    | 1,18 %   | 3.040.713,702 |                                    | 1,82                         | 1,68               | 2,02               |
| AM30 SGD                                    | 1,18 %   | 169.265,584   |                                    | 9,77                         | 8,65               | 9,43               |
| BC  | 0,75 %   | 14.536,489    |                                    | 19,08                        | 16,11              | 17,18              |
| BC GBP                                      | 0,75 %   | 16.269,231    |                                    | 27,39                        | 23,13              | 24,66              |
| EC  | 1,45 %   | 9.378,179     |                                    | 16,76                        | 14,25              | 15,30              |
| ECO EUR**                                   | -  | -             |                                    | -                            | -                  | 15,58              |
| <b>Gesamtnettovermögen</b>                  |  |               |                                    | <b>129.131.294</b>           | <b>118.997.825</b> | <b>132.343.709</b> |
| <b>Brazil Equity USD</b>                    |  |               |                                    |                              |                    |                    |
| AC  | 2,16 %   | 2.216.377,720 |                                    | 16,82                        | 13,82              | 18,20              |
| AC EUR                                      | 2,16 %   | 61.039,176    |                                    | 6,22                         | 5,11               | 6,73               |
| AC GBP                                      | 2,16 %   | 34.003,398    |                                    | 8,37                         | 6,87               | 9,05               |
| AD  | 2,16 %   | 5.070.682,425 |                                    | 13,26                        | 11,59              | 15,93              |
| AD GBP                                      | 2,16 %   | 5.397,595     |                                    | 6,48                         | 5,66               | 7,78               |
| AD HKD                                      | 2,16 %   | 1.721.342,191 |                                    | 0,43                         | 0,38               | 0,52               |
| BC  | 1,28 %   | 53.287,209    |                                    | 6,75                         | 5,50               | 7,18               |
| BC GBP                                      | 1,28 %   | 118.933,458   |                                    | 9,89                         | 8,05               | 10,51              |
| BD  | 1,28 %   | 12.599,912    |                                    | 5,97                         | 5,23               | 7,20               |
| BD GBP                                      | 1,28 %   | 17.989,630    |                                    | 7,30                         | 6,38               | 8,80               |
| EC  | 2,66 %   | 194.156,646   |                                    | 15,36                        | 12,68              | 16,79              |
| ED  | 2,62 %   | 104,608       |                                    | 13,04                        | 11,39              | 15,63              |
| IC  | 1,18 %   | 12.905,771    |                                    | 20,07                        | 16,32              | 21,29              |
| ID  | 1,18 %   | 3.365,000     |                                    | 13,55                        | 11,86              | 16,35              |
| J1C   | 1,00 %   | 1.775.338,594 |                                    | 11,44                        | 9,29               | -                  |
| S3D   | 0,85 %   | 327.742,870   |                                    | 13,90                        | 12,16              | 16,78              |
| XC  | 0,90 %   | 500,000       |                                    | 7,59                         | 6,15               | 8,01               |
| ZC  | 0,22 %   | 509.913,082   |                                    | 24,26                        | 19,55              | 25,25              |
| <b>Gesamtnettovermögen</b>                  |  |               |                                    | <b>148.204.136</b>           | <b>139.910.375</b> | <b>163.539.216</b> |

\* Nettoinventarwert je Anteil mit Swing-Korrektur (siehe Erläuterung 14),

\*\* Die Anteilsklassen sind zum 31. März 2024 inaktiv,

Der Nettoinventarwert je Anteil ist stets in der Währung des Teilfonds angegeben.

# Wichtige Kennzahlen

zum 31. März 2024

| Teilfonds  | Gesamtkostenquote<br>(TER)/synthetische TER |                | Anteile in Umlauf<br>31. März 2024 | Nettoinventarwert je Anteil* |                      |               |
|--|---|----------------|------------------------------------|------------------------------|----------------------|---------------|
|  | 31. März 2024<br>(siehe Erläuterung 15)     |                |                                    | 31. März 2024                | 31. März 2023        | 31. März 2022 |
| <b>Economic Scale US Equity</b>                      |   |                |                                    |                              |                      |               |
| USD  |   |                |                                    |                              |                      |               |
| AC   | 0,95 %                                      | 1.410.610,002  | 73,43                              | 59,61                        | 65,44                |               |
| ACH EUR  | 0,97 %                                      | 779.264,277    | 54,52                              | 45,51                        | 53,22                |               |
| AD   | 0,95 %                                      | 61.142,553     | 78,24                              | 63,91                        | 70,45                |               |
| ADH EUR  | 0,97 %                                      | 15.015,985     | 53,63                              | 45,04                        | 52,89                |               |
| BC   | 0,65 %                                      | 10.601,340     | 17,73                              | 14,35                        | 15,71                |               |
| BC GBP   | 0,65 %                                      | 5.308,201      | 34,44                              | 27,88                        | 30,51                |               |
| BCH EUR  | 0,67 %                                      | 1.127,336      | 17,60                              | -                            | 16,23                |               |
| BD   | 0,65 %                                      | 920,002        | 15,06                              | 12,30                        | 13,57                |               |
| BD GBP   | 0,65 %                                      | 114.249,051    | 24,38                              | 19,91                        | 21,96                |               |
| EC   | 1,25 %                                      | 26.649,515     | 68,62                              | 55,87                        | 61,52                |               |
| ECH EUR  | 1,28 %                                      | 1.815,871      | 17,99                              | 15,07                        | 17,67                |               |
| IC   | 0,55 %                                      | 76.335,267     | 80,61                              | 65,18                        | 71,27                |               |
| ICH EUR  | 0,57 %                                      | 15.001,119     | 20,65                              | 17,17                        | 19,99                |               |
| ID   | 0,55 %                                      | 143.838,619    | 29,94                              | 24,46                        | 26,98                |               |
| PD   | 0,75 %                                      | 1.069.408,423  | 81,82                              | 66,81                        | 73,68                |               |
| XD   | 0,50 %                                      | 689,599        | 21,52                              | 17,58                        | 19,39                |               |
| YD   | 0,40 %                                      | 228.662,271    | 29,18                              | 23,84                        | 26,30                |               |
| ZC   | 0,13 %                                      | 109.797,199    | 23,51                              | 18,93                        | 20,61                |               |
| ZD   | 0,25 %                                      | 17.778,048     | 79,50                              | 64,94                        | 71,70                |               |
| <b>Gesamtnettovermögen</b>                           |   |                | <b>265.657.320</b>                 | <b>260.843.203</b>           | <b>333.553.195</b>   |               |
| <b>Indian Equity</b>                                 |   |                |                                    |                              |                      |               |
| USD  |   |                |                                    |                              |                      |               |
| AC   | 1,90 %                                      | 952.177,535    | 299,17                             | 225,35                       | 250,00               |               |
| AC CHF   | 1,90 %                                      | 34.476,945     | 19,86                              | 14,96                        | 16,60                |               |
| AC EUR   | 1,90 %                                      | 35.445,239     | 28,66                              | 21,59                        | 23,95                |               |
| AC GBP   | 1,90 %                                      | 65.117,021     | 33,39                              | 25,15                        | 27,91                |               |
| AD   | 1,90 %                                      | 2.783.455,432  | 295,04                             | 222,25                       | 246,55               |               |
| AD EUR   | 1,90 %                                      | 100.519,711    | 24,98                              | 18,82                        | 20,88                |               |
| AD GBP   | 1,90 %                                      | 6.570,697      | 32,95                              | 24,82                        | 27,53                |               |
| AD HKD   | 1,90 %                                      | 8.000.713,600  | 2,13                               | 1,61                         | 1,78                 |               |
| BC   | 1,15 %                                      | 444.944,738    | 26,44                              | 19,77                        | 21,77                |               |
| BC GBP   | 1,15 %                                      | 219.015,637    | 35,68                              | 26,68                        | 29,37                |               |
| BD   | 1,15 %                                      | 326.100,941    | 25,90                              | 19,37                        | 21,33                |               |
| BD GBP   | 1,15 %                                      | 33.531,547     | 34,70                              | 25,94                        | 28,57                |               |
| EC   | 2,41 %                                      | 22.504,511     | 269,40                             | 203,94                       | 227,39               |               |
| ED   | 2,41 %                                      | 40,000         | 267,47                             | 202,48                       | 225,76               |               |
| FC   | 0,54 %                                      | 26.500,000     | 362,17                             | 269,17                       | 294,45               |               |
| IC   | 1,05 %                                      | 21.715,008     | 357,85                             | 267,30                       | 294,02               |               |
| IC EUR   | 1,05 %                                      | 128.157,061    | 23,11                              | 17,26                        | 18,99                |               |
| ID   | 1,05 %                                      | 27.793,485     | 336,36                             | 251,24                       | 276,36               |               |
| J1C  | 1,00 %                                      | 1.609.125,239  | 13,04                              | 9,74                         | -                    |               |
| XD   | 0,90 %                                      | 19.102,974     | 17,61                              | 13,13                        | 14,42                |               |
| ZC   | 0,16 %                                      | 1.512.755,000  | 18,01                              | 13,33                        | 14,54                |               |
| ZD   | 0,16 %                                      | 514.895,603    | 341,06                             | 254,12                       | 278,95               |               |
| <b>Gesamtnettovermögen</b>                           |   |                | <b>1.413.083.015</b>               | <b>953.319.973</b>           | <b>1.113.713.545</b> |               |
| <b>Mexico Equity (geschlossen zum 28. Juli 2023)</b> |   |                |                                    |                              |                      |               |
| USD  |   |                |                                    |                              |                      |               |
| AC   | -   | -              | -                                  | 10,17                        | 8,90                 |               |
| EC   | -   | -              | -                                  | 10,36                        | 9,11                 |               |
| IC EUR   | -   | -              | -                                  | 14,00                        | 12,14                |               |
| JC   | -   | -              | -                                  | -                            | 9,97                 |               |
| <b>Gesamtnettovermögen</b>                           |   |                |                                    | <b>16.115.320</b>            | <b>36.120.298</b>    |               |
| <b>Russia Equity**</b>                               |   |                |                                    |                              |                      |               |
| USD  |   |                |                                    |                              |                      |               |
| AC   | -   | 1.441.893,900  | 0,83                               | 0,73                         | 0,91                 |               |
| AC EUR   | -   | 38.646,828     | 1,49                               | 1,30                         | 1,46                 |               |
| AC GBP   | -   | 7.579,193      | 1,90                               | 1,66                         | 1,57                 |               |
| AD   | -   | 13.075.073,414 | 0,68                               | 0,59                         | 0,74                 |               |
| AD GBP   | -   | 61.341,865     | 1,63                               | 1,43                         | 1,35                 |               |
| AD HKD   | -   | 7.605.578,812  | 0,10                               | 0,09                         | 0,85                 |               |
| BC   | -   | 96.281,431     | 1,42                               | 1,24                         | 1,55                 |               |
| BC GBP   | -   | 30.934,068     | 3,50                               | 3,07                         | 2,91                 |               |
| EC   | -   | 259.724,327    | 0,78                               | 0,68                         | 0,84                 |               |
| IC   | -   | 348.265,926    | 0,96                               | 0,84                         | 1,05                 |               |
| ZC   | -   | 14.087,321     | 1,87                               | 1,63                         | 2,05                 |               |
| <b>Gesamtnettovermögen</b>                           |   |                | <b>11.787.329</b>                  | <b>10.312.334</b>            | <b>12.805.978</b>    |               |

\* Nettoinventarwert je Anteil mit Swing-Korrektur (siehe Erläuterung 14),

\*\* Der Handel und die Berechnung des Nettoinventarwerts des Teilfonds Russia Equity sind seit 25. Februar 2022 aufgrund der Schließung der Moskauer Börse ausgesetzt. Ein indikativer Nettoinventarwert zum 31. März 2024 wurde lediglich zu Darstellungszwecken im Jahresabschluss errechnet. Der Ausschuss für die Preisbestimmung und die Verwaltungsgesellschaft haben vereinbart und veranlasst, dass alle auf Rubel lautenden russischen Aktien im Anlageportfolio auf null abgeschrieben werden.

Der Nettoinventarwert je Anteil ist stets in der Währung des Teilfonds angegeben.

# Wichtige Kennzahlen

zum 31. März 2024

| Teilfonds                  | Gesamtkostenquote<br>(TER)/synthetische<br>TER |  | Anteile in Umlauf<br>31. März 2024 | Nettoinventarwert je Anteil* |                    |                    |
|----------------------------|--|--|------------------------------------|------------------------------|--------------------|--------------------|
|                            | 31. März 2024<br>(siehe Erläuterung 15)        |  |                                    | 31. März 2024                | 31. März 2023      | 31. März 2022      |
| <b>Turkey Equity</b>       |  |  |                                    |                              |                    |                    |
| EUR                        |  |  |                                    |                              |                    |                    |
| AC                         | 2,16 %   |  | 993.103,550                        | 51,73                        | 40,95              | 20,27              |
| AC GBP                     | 2,16 %   |  | 23.212,341                         | 32,75                        | 25,93              | 12,83              |
| AD                         | 2,16 %   |  | 278.496,944                        | 35,44                        | 28,34              | 14,33              |
| AD GBP                     | 2,16 %   |  | 560,124                            | 30,01                        | 23,99              | 12,13              |
| BC                         | 1,28 %   |  | 64.826,903                         | 24,10                        | 18,91              | 9,28               |
| BC GBP                     | 1,28 %   |  | 360.682,084                        | 26,17                        | 20,54              | 10,08              |
| BD                         | 1,28 %   |  | 2.121,061                          | 20,50                        | 16,36              | 8,27               |
| BD GBP                     | 1,28 %   |  | 25.814,876                         | 27,31                        | 21,80              | 11,02              |
| EC                         | 2,66 %   |  | 128.681,896                        | 47,59                        | 37,86              | 18,84              |
| IC                         | 1,18 %   |  | 254.065,339                        | 60,34                        | 47,31              | 23,19              |
| <b>Gesamtnettovermögen</b> |  |  |                                    | <b>95.215.824</b>            | <b>99.347.576</b>  | <b>45.345.681</b>  |
| <b>Asia Bond</b>           |  |  |                                    |                              |                    |                    |
| USD                        |  |  |                                    |                              |                    |                    |
| AC                         | 1,40 %   |  | 168.231,442                        | 10,26                        | 9,94               | 10,58              |
| ACH EUR                    | 1,42 %   |  | 109.935,666                        | 8,93                         | 8,87               | 9,94               |
| AM2                        | 1,40 %   |  | 1.106,227                          | 7,81                         | 8,07               | 9,12               |
| AM3H SGD                   | 1,41 %   |  | 31.214,949                         | 5,62                         | 5,90               | 6,56               |
| BC                         | 0,86 %   |  | 65.253,964                         | 10,71                        | 10,31              | 10,92              |
| FC                         | 0,43 %   |  | 169.205,000                        | 9,08                         | 8,71               | 9,17               |
| FDH EUR                    | 0,45 %   |  | 167.965,000                        | 8,52                         | 8,69               | 9,77               |
| IC                         | 0,80 %   |  | 1.472.822,366                      | 10,78                        | 10,38              | 10,98              |
| ICH EUR                    | 0,82 %   |  | 17.442,875                         | 10,19                        | 10,06              | 11,20              |
| IDH EUR                    | 0,82 %   |  | 940.587,000                        | 8,26                         | 8,44               | 9,76               |
| S47M3H SGD                 | 1,32 %   |  | 5.732,511                          | 7,43                         | -                  | -                  |
| XC**                       | -  |  | -                                  | -                            | 10,48              | 11,07              |
| XDH EUR                    | 0,65 %   |  | 2.955.100,000                      | 8,35                         | 8,52               | 9,85               |
| ZDH EUR                    | 0,15 %   |  | 3.201.091,507                      | 8,62                         | 8,79               | 10,19              |
| ZQ1                        | 0,19 %   |  | 12.177.082,266                     | 8,12                         | 8,14               | 8,91               |
| ZQ1H AUD                   | 0,27 %   |  | 56.834,642                         | 5,00                         | 5,23               | 6,50               |
| ZQ1H CHF                   | 0,21 %   |  | 108.130,000                        | 8,08                         | 8,33               | 9,36               |
| ZQ1H EUR                   | 0,19 %   |  | 1.633.872,919                      | 8,13                         | 8,37               | 9,63               |
| ZQ1H GBP                   | 0,17 %   |  | 16.388.695,786                     | 9,80                         | 9,67               | 11,39              |
| ZQ1H SGD                   | 0,20 %   |  | 383.084,996                        | 5,73                         | 5,94               | 6,43               |
| <b>Gesamtnettovermögen</b> |  |  |                                    | <b>358.708.876</b>           | <b>491.814.430</b> | <b>499.733.976</b> |
| <b>Asia ESG Bond</b>       |  |  |                                    |                              |                    |                    |
| USD                        |  |  |                                    |                              |                    |                    |
| AC                         | 1,55 %   |  | 100,000                            | 9,15                         | 8,89               | 9,49               |
| ACO CHF                    | 1,54 %   |  | 91,000                             | 9,41                         | 9,39               | 10,28              |
| ACO EUR                    | 1,41 %   |  | 118,619                            | 9,44                         | 9,39               | 10,53              |
| ACO GBP                    | 1,39 %   |  | 184,615                            | 11,39                        | 10,88              | 12,49              |
| ACO HKD                    | 1,58 %   |  | 778,000                            | 1,15                         | 1,12               | 1,21               |
| ACO RMB                    | 1,44 %   |  | 634,000                            | 1,22                         | 1,29               | 1,50               |
| ACO SGD                    | 1,55 %   |  | 134,000                            | 6,62                         | 6,65               | 7,01               |
| AM2                        | 1,45 %   |  | 40.848,666                         | 7,94                         | 8,26               | 9,44               |
| AM2 HKD                    | 1,43 %   |  | 6.456,050                          | 1,02                         | 1,06               | 1,21               |
| AM30 AUD                   | 1,42 %   |  | 153,787                            | 5,16                         | 5,52               | 7,09               |
| AM30 EUR                   | 1,41 %   |  | 95,623                             | 8,55                         | 8,96               | 10,49              |
| AM30 GBP                   | 1,48 %   |  | 7.104,782                          | 9,99                         | 10,19              | 12,43              |
| AM30 HKD                   | 1,57 %   |  | 877,787                            | 1,01                         | 1,05               | 1,21               |
| AM30 RMB                   | 1,48 %   |  | 40.361,126                         | 1,09                         | 1,20               | 1,49               |
| AM30 SGD                   | 1,48 %   |  | 6.459,539                          | 5,87                         | 6,21               | 6,98               |
| IC                         | 0,81 %   |  | 100,000                            | 9,30                         | 8,97               | 9,50               |
| ICO CHF                    | 0,83 %   |  | 91,000                             | 9,55                         | 9,46               | 10,29              |
| ICO EUR                    | 0,88 %   |  | 87,000                             | 9,56                         | 9,46               | 10,55              |
| ICO GBP                    | 0,88 %   |  | 73,000                             | 11,54                        | 10,96              | 12,51              |
| ICO HKD                    | 0,82 %   |  | 778,000                            | 1,17                         | 1,13               | 1,21               |
| ICO RMB                    | 0,89 %   |  | 634,000                            | 1,24                         | 1,30               | 1,50               |
| ICO SGD                    | 0,82 %   |  | 134,000                            | 6,73                         | 6,71               | 7,02               |
| XC                         | 0,62 %   |  | 100,000                            | 9,34                         | 8,99               | 9,50               |
| XCO CHF                    | 0,57 %   |  | 91,000                             | 9,61                         | 9,49               | 10,30              |
| XCO EUR                    | 0,54 %   |  | 87,000                             | 9,62                         | 9,49               | 10,55              |
| XCO GBP                    | 0,54 %   |  | 73,000                             | 11,61                        | 11,00              | 12,51              |
| XCO HKD                    | 0,55 %   |  | 778,000                            | 1,17                         | 1,14               | 1,21               |
| XCO RMB                    | 0,56 %   |  | 634,000                            | 1,25                         | 1,31               | 1,50               |
| XCO SGD                    | 0,66 %   |  | 137,000                            | 6,75                         | 6,72               | 7,02               |
| ZC                         | 0,25 %   |  | 2.703.522,000                      | 9,45                         | 9,06               | 9,54               |
| <b>Gesamtnettovermögen</b> |  |  |                                    | <b>26.060.641</b>            | <b>45.388.691</b>  | <b>47.704.166</b>  |

\* Nettoinventarwert je Anteil mit Swing-Korrektur (siehe Erläuterung 14),

\*\* Die Anteilsklassen sind zum 31. März 2024 inaktiv,

Der Nettoinventarwert je Anteil ist stets in der Währung des Teilfonds angegeben.

# Wichtige Kennzahlen

zum 31. März 2024

| Teilfonds                        | Gesamtkostenquote<br>(TER)/synthetische<br>TER |  | Anteile in Umlauf<br>31. März 2024 | Nettoinventarwert je Anteil* |                      |                      |
|----------------------------------|--|--|------------------------------------|------------------------------|----------------------|----------------------|
|                                  | 31. März 2024<br>(siehe Erläuterung 15)        |  |                                    | 31. März 2024                | 31. März 2023        | 31. März 2022        |
| <b>Asia High Yield Bond USD</b>  |  |  |                                    |                              |                      |                      |
| AC                               | 1,60 %   |  | 8.327.306,281                      | 7,19                         | 7,40                 | 8,28                 |
| ACH CHF                          | 1,63 %   |  | 18.766,675                         | 7,05                         | 7,45                 | 8,56                 |
| ACH EUR                          | 1,63 %   |  | 237.055,118                        | 7,12                         | 7,51                 | 8,85                 |
| ADH EUR                          | 1,63 %   |  | 12.500,000                         | 7,29                         | 8,37                 | 10,15                |
| AM                               | 1,60 %   |  | 4.005.797,298                      | 5,31                         | 6,00                 | 7,26                 |
| AM2                              | 1,60 %   |  | 24.210.002,215                     | 5,03                         | 5,82                 | 7,43                 |
| AM2 HKD                          | 1,60 %   |  | 15.309.022,045                     | 0,61                         | 0,70                 | 0,90                 |
| AM3H AUD                         | 1,63 %   |  | 1.961.351,614                      | 3,26                         | 3,88                 | 5,57                 |
| AM3H SGD                         | 1,63 %   |  | 10.761.290,956                     | 3,45                         | 4,06                 | 5,10                 |
| BC                               | 0,98 %   |  | 2.008.114,905                      | 7,04                         | 7,20                 | 8,01                 |
| BD                               | 0,98 %   |  | 214.530,924                        | 5,52                         | 6,20                 | 7,47                 |
| BDH CHF                          | 1,00 %   |  | 119.116,720                        | 6,02                         | 6,92                 | 8,31                 |
| BDH EUR                          | 1,00 %   |  | 107.914,442                        | 5,55                         | 6,38                 | 8,20                 |
| IC                               | 0,88 %   |  | 3.251.513,562                      | 7,42                         | 7,58                 | 8,43                 |
| IM2                              | 0,88 %   |  | 5.036.046,202                      | 4,67                         | 5,37                 | 6,80                 |
| IM3H SGD                         | 0,90 %   |  | 397.485,594                        | 3,55                         | 4,15                 | 5,17                 |
| PCH SGD                          | 1,38 %   |  | 308.431,996                        | 5,40                         | 5,73                 | 6,33                 |
| PM2                              | 1,35 %   |  | 5.148.400,418                      | 5,06                         | 5,85                 | 7,45                 |
| PM3H AUD                         | 1,38 %   |  | 829.394,973                        | 3,28                         | 3,90                 | 5,58                 |
| PM3H EUR                         | 1,38 %   |  | 819.339,343                        | 5,45                         | 6,35                 | 8,30                 |
| PM3H SGD                         | 1,38 %   |  | 9.903.738,303                      | 3,73                         | 4,38                 | 5,49                 |
| S40C                             | 0,63 %   |  | 158,800                            | 8,70                         | 8,87                 | -                    |
| S40M2                            | 0,62 %   |  | 2.028.295,756                      | 6,93                         | 7,95                 | -                    |
| XC                               | 0,73 %   |  | 14.883.996,024                     | 7,47                         | 7,62                 | 8,45                 |
| XCH CHF                          | 0,78 %   |  | 4.538,885                          | 6,70                         | 7,01                 | 7,99                 |
| XCH EUR                          | 0,76 %   |  | 31.965,223                         | 6,80                         | 7,11                 | 8,30                 |
| XCH GBP**                        | -  |  | -                                  | -                            | -                    | 9,85                 |
| XD                               | 0,72 %   |  | 1.299.000,000                      | 5,92                         | 6,65                 | 8,04                 |
| XM2**                            | -  |  | -                                  | -                            | -                    | 6,97                 |
| ZBFIX8.5H JPY                    | 0,27 %   |  | 8.342,340                          | 31,11                        | 41,50                | 56,79                |
| ZC                               | 0,12 %   |  | 3.022.550,851                      | 7,28                         | 7,38                 | 8,14                 |
| ZCH EUR                          | 0,14 %   |  | 167.076,540                        | 6,96                         | 7,24                 | 8,41                 |
| ZQ1                              | 0,12 %   |  | 15.212.861,084                     | 5,31                         | 6,00                 | 7,28                 |
| ZQ1H AUD                         | 0,26 %   |  | 23.873,424                         | 3,27                         | 3,86                 | 5,34                 |
| ZQ1H CHF                         | 0,19 %   |  | 37.181,000                         | 5,27                         | 6,13                 | 7,63                 |
| ZQ1H EUR                         | 0,16 %   |  | 2.015.017,981                      | 5,31                         | 6,17                 | 7,88                 |
| ZQ1H GBP                         | 0,17 %   |  | 3.094.137,312                      | 6,49                         | 7,23                 | 9,45                 |
| ZQ1H JPY                         | 0,14 %   |  | 94.092,000                         | 31,17                        | 42,61                | 58,87                |
| ZQ1H SGD                         | 0,21 %   |  | 167.365,885                        | 3,78                         | 4,43                 | 5,31                 |
| <b>Gesamtneuvermögen</b>         |  |  |                                    | <b>667.135.244</b>           | <b>1.142.030.519</b> | <b>2.467.389.690</b> |
| <b>Asian Currencies Bond USD</b> |  |  |                                    |                              |                      |                      |
| AC                               | 1,60 %   |  | 54.836,054                         | 9,60                         | 9,85                 | 10,13                |
| AC EUR                           | 1,60 %   |  | 38.321,608                         | 12,86                        | 13,19                | 13,56                |
| AD                               | 1,60 %   |  | 93.905,674                         | 6,71                         | 7,19                 | 7,72                 |
| EC                               | 1,91 %   |  | 1.654,354                          | 8,95                         | 9,21                 | 9,50                 |
| IC                               | 0,88 %   |  | 287.132,826                        | 8,93                         | 9,10                 | 9,29                 |
| ID EUR                           | 0,85 %   |  | 200,000                            | 8,91                         | 10,10                | 10,86                |
| ZD                               | 0,25 %   |  | 2.635.489,999                      | 7,28                         | 7,81                 | 8,45                 |
| <b>Gesamtneuvermögen</b>         |  |  |                                    | <b>23.415.439</b>            | <b>35.053.330</b>    | <b>46.698.461</b>    |
| <b>Brazil Bond USD</b>           |  |  |                                    |                              |                      |                      |
| AC                               | 1,35 %   |  | 1.194.403,632                      | 21,62                        | 18,89                | 18,27                |
| AD                               | 1,35 %   |  | 415.354,136                        | 6,71                         | 6,11                 | 6,25                 |
| BC                               | 0,85 %   |  | 273.714,093                        | 12,19                        | 10,59                | 10,20                |
| BD GBP                           | 0,85 %   |  | 29.234,334                         | 14,55                        | 12,73                | -                    |
| EC                               | 1,65 %   |  | 113.812,067                        | 20,52                        | 17,98                | 17,45                |
| ED                               | 1,65 %   |  | 31.324,603                         | 8,15                         | 7,42                 | 7,60                 |
| IC                               | 0,75 %   |  | 140.451,516                        | 23,80                        | 20,67                | 19,88                |
| ZD                               | 0,26 %   |  | 402,000                            | 7,17                         | 6,52                 | 6,68                 |
| <b>Gesamtneuvermögen</b>         |  |  |                                    | <b>38.301.494</b>            | <b>31.846.377</b>    | <b>31.688.944</b>    |

\* Nettoinventarwert je Anteil mit Swing-Korrektur (siehe Erläuterung 14),

\*\* Die Anteilsklassen sind zum 31. März 2024 inaktiv,

Der Nettoinventarwert je Anteil ist stets in der Währung des Teilfonds angegeben.

# Wichtige Kennzahlen

zum 31. März 2024

| Teilfonds  | Gesamtkostenquote<br>(TER)/synthetische<br>TER | Anteile in Umlauf<br>31. März 2024 | Nettoinventarwert je Anteil* |                    |                    |
|--|--|------------------------------------|------------------------------|--------------------|--------------------|
|  | 31. März 2024<br>(siehe Erläuterung 15)        |                                    | 31. März 2024                | 31. März 2023      | 31. März 2022      |
| <b>Corporate Euro Bond Fixed Term 2027 (aufgelegt zum 30. Juni 2023) EUR</b> |  |                                    |                              |                    |                    |
| AC   | 0,76 %   | 10.944.558,425                     | 10,57                        | -                  | -                  |
| AD   | 0,78 %   | 659.415,245                        | 10,57                        | -                  | -                  |
| BC   | 0,46 %   | 2.526.788,124                      | 10,60                        | -                  | -                  |
| BCH USD  | 0,48 %   | 248.749,941                        | 9,94                         | -                  | -                  |
| BD   | 0,46 %   | 1.895.221,037                      | 10,60                        | -                  | -                  |
| ZC   | 0,17 %   | 320.000,000                        | 10,47                        | -                  | -                  |
| BDH USD  | 0,50 %   | 102.062,939                        | 9,81                         | -                  | -                  |
| EC   | 1,08 %   | 339.834,870                        | 10,55                        | -                  | -                  |
| ED   | 1,10 %   | 45.678,870                         | 10,55                        | -                  | -                  |
| IC   | 0,47 %   | 99.012,070                         | 10,59                        | -                  | -                  |
| <b>Gesamtnettovermögen</b>   |  |                                    | <b>181.498.779</b>           | <b>-</b>           | <b>-</b>           |
| <b>Euro Bond EUR</b>   |  |                                    |                              |                    |                    |
| AC   | 1,00 %   | 309.187,408                        | 24,82                        | 23,81              | 26,86              |
| AD   | 1,00 %   | 104.305,866                        | 18,07                        | 17,34              | 19,56              |
| EC   | 1,30 %   | 29.467,387                         | 23,57                        | 22,68              | 25,66              |
| IC   | 0,53 %   | 56.171,327                         | 27,42                        | 26,19              | 29,40              |
| ID   | 0,53 %   | 121.494,188                        | 9,31                         | 8,93               | 10,06              |
| S18C   | 0,30 %   | 4.230.011,170                      | 9,79                         | 9,32               | 10,44              |
| XCH JPY**  | -  | -                                  | -                            | 56,97              | 69,31              |
| ZC   | 0,15 %   | 95.915,000                         | 11,11                        | 10,57              | 11,82              |
| <b>Gesamtnettovermögen</b>   |  |                                    | <b>55.388.592</b>            | <b>57.075.368</b>  | <b>111.508.277</b> |
| <b>Euro Bond Total Return EUR</b>  |  |                                    |                              |                    |                    |
| AC   | 1,15 %   | 82.062,542                         | 11,51                        | 10,88              | 11,35              |
| AD   | 1,15 %   | 16.378,497                         | 10,20                        | 9,79               | 10,22              |
| BC   | 0,70 %   | 17.672,000                         | 10,76                        | 10,13              | 10,52              |
| EC   | 1,45 %   | 16.114,120                         | 11,16                        | 10,58              | 11,07              |
| IC   | 0,65 %   | 328.259,233                        | 12,12                        | 11,40              | 11,83              |
| ID   | 0,65 %   | 270.348,181                        | 10,45                        | 10,03              | 10,48              |
| S10C**   | -  | -                                  | -                            | 11,25              | 11,64              |
| ZC   | 0,18 %   | 6.656.218,432                      | 12,74                        | 11,93              | 12,32              |
| <b>Gesamtnettovermögen</b>   |  |                                    | <b>93.095.852</b>            | <b>124.766.811</b> | <b>170.400.970</b> |
| <b>Euro Credit Bond EUR</b>  |  |                                    |                              |                    |                    |
| AC   | 1,10 %   | 1.017.096,823                      | 25,69                        | 24,27              | 26,61              |
| AD   | 1,10 %   | 65.853,880                         | 16,48                        | 15,74              | 17,26              |
| BC   | 0,68 %   | 5.260.002,871                      | 9,76                         | 9,18               | 10,03              |
| EC   | 1,40 %   | 13.772,405                         | 24,41                        | 23,13              | 25,44              |
| IC   | 0,63 %   | 1.178.431,008                      | 28,67                        | 26,95              | 29,42              |
| ID   | 0,63 %   | 2.836.486,737                      | 10,04                        | 9,59               | 10,47              |
| S19C   | 0,38 %   | 12.835.349,212                     | 10,49                        | 9,84               | 10,72              |
| XC   | 0,48 %   | 1.657.507,217                      | 11,07                        | 10,39              | 11,32              |
| XD   | 0,47 %   | 4.447.447,349                      | 9,51                         | 9,08               | 9,91               |
| ZC   | 0,13 %   | 7.988.483,586                      | 11,09                        | 10,37              | 11,26              |
| <b>Gesamtnettovermögen</b>   |  |                                    | <b>425.040.612</b>           | <b>345.254.148</b> | <b>376.502.833</b> |

\* Nettoinventarwert je Anteil mit Swing-Korrektur (siehe Erläuterung 14),

\*\* Die Anteilsklassen sind zum 31. März 2024 inaktiv,

Der Nettoinventarwert je Anteil ist stets in der Währung des Teilfonds angegeben.

# Wichtige Kennzahlen

zum 31. März 2024

| Teilfonds                             | Gesamtkostenquote<br>(TER)/synthetische<br>TER |  | Anteile in Umlauf<br>31. März 2024 | Nettoinventarwert je Anteil* |                      |                      |
|---------------------------------------|--|--|------------------------------------|------------------------------|----------------------|----------------------|
|                                       | 31. März 2024<br>(siehe Erläuterung 15)        |  |                                    | 31. März 2024                | 31. März 2023        | 31. März 2022        |
| <b>Euro High Yield Bond</b>           |  |  |                                    |                              |                      |                      |
| EUR                                   |  |  |                                    |                              |                      |                      |
| AC                                    | 1,35 %   |  | 1.421.776,305                      | 45,03                        | 41,08                | 44,21                |
| ACH CAD**                             | -  |  | -                                  | -                            | -                    | 8,52                 |
| ACH USD                               | 1,38 %   |  | 92.221,187                         | 12,88                        | 11,48                | 11,75                |
| AD                                    | 1,35 %   |  | 776.122,991                        | 21,35                        | 20,04                | 22,07                |
| AM2                                   | 1,35 %   |  | 102.723,997                        | 9,49                         | 9,24                 | 10,49                |
| BC                                    | 0,80 %   |  | 1.586.639,038                      | 13,62                        | 12,36                | 13,23                |
| BD                                    | 0,80 %   |  | 18.991,710                         | 10,03                        | 9,41                 | 10,42                |
| EC                                    | 1,65 %   |  | 61.362,317                         | 42,75                        | 39,11                | 42,23                |
| ED                                    | 1,65 %   |  | 8.366,871                          | 25,22                        | 23,67                | 26,06                |
| IC                                    | 0,75 %   |  | 4.513.381,532                      | 51,46                        | 46,67                | 49,93                |
| ICH CHF                               | 0,77 %   |  | 3.000,000                          | 11,93                        | 10,85                | 11,35                |
| ICH USD                               | 0,77 %   |  | 575.431,040                        | 13,38                        | 11,86                | 12,07                |
| ID                                    | 0,75 %   |  | 1.148.012,302                      | 33,87                        | 31,79                | 35,05                |
| S8C                                   | 0,50 %   |  | 12.628.910,182                     | 12,31                        | 11,14                | 11,88                |
| S8D                                   | 0,50 %   |  | 9.897.495,544                      | 10,66                        | 10,01                | 11,04                |
| XC                                    | 0,63 %   |  | 433.812,013                        | 52,66                        | 47,70                | 50,97                |
| XD                                    | 0,61 %   |  | 543.479,000                        | 9,75                         | 9,15                 | 10,10                |
| ZC                                    | 0,12 %   |  | 1.119.689,426                      | 57,00                        | 51,37                | 54,61                |
| ZQ1                                   | 0,11 %   |  | 1.640.000,000                      | 9,07                         | 8,50                 | 9,42                 |
| <b>Gesamtnettovermögen</b>            |  |  |                                    | <b>754.063.228</b>           | <b>1.041.658.661</b> | <b>1.407.906.842</b> |
| <b>ESG Short Duration Credit Bond</b> |  |  |                                    |                              |                      |                      |
| USD                                   |  |  |                                    |                              |                      |                      |
| AC                                    | 1,00 %   |  | 10.000,000                         | 10,60                        | 10,03                | -                    |
| AM2                                   | 1,00 %   |  | 47.288,524                         | 9,87                         | 9,93                 | -                    |
| AM2H SGD                              | 1,03 %   |  | 151.341,822                        | 7,20                         | -                    | -                    |
| AM3H AUD                              | 1,03 %   |  | 37.527,995                         | 6,43                         | 6,65                 | -                    |
| AM3H EUR                              | 1,03 %   |  | 26.092,692                         | 10,65                        | 10,79                | -                    |
| AM3H GBP                              | 1,03 %   |  | 38.778,815                         | 12,45                        | 12,28                | -                    |
| AM3H SGD**                            | -  |  | -                                  | -                            | 7,47                 | -                    |
| BC                                    | 0,63 %   |  | 10.000,000                         | 10,64                        | 10,03                | -                    |
| BCH EUR                               | 0,65 %   |  | 10.000,000                         | 11,23                        | 10,86                | -                    |
| BCH GBP                               | 0,65 %   |  | 10.000,000                         | 13,35                        | 12,39                | -                    |
| BM2                                   | 0,63 %   |  | 10.682,822                         | 9,91                         | 9,94                 | -                    |
| BM3H CHF                              | 0,65 %   |  | 10.230,599                         | 10,98                        | 10,87                | -                    |
| BM3H EUR                              | 0,65 %   |  | 10.457,478                         | 10,69                        | 10,79                | -                    |
| BM3H GBP                              | 0,65 %   |  | 10.621,898                         | 12,51                        | 12,28                | -                    |
| ZQ1                                   | 0,15 %   |  | 358.836,987                        | 10,00                        | 9,89                 | -                    |
| ZQ1H CHF                              | 0,17 %   |  | 10.556,391                         | 10,57                        | 10,75                | -                    |
| ZQ1H EUR                              | 0,17 %   |  | 10.565,656                         | 10,53                        | 10,70                | -                    |
| ZQ1H GBP                              | 0,17 %   |  | 10.550,539                         | 12,54                        | 12,21                | -                    |
| <b>Gesamtnettovermögen</b>            |  |  |                                    | <b>7.420.114</b>             | <b>5.504.133</b>     | <b>-</b>             |

\* Nettoinventarwert je Anteil mit Swing-Korrektur (siehe Erläuterung 14),

\*\* Die Anteilsklassen sind zum 31. März 2024 inaktiv,

Der Nettoinventarwert je Anteil ist stets in der Währung des Teilfonds angegeben.



# Wichtige Kennzahlen

zum 31. März 2024

| Teilfonds                       | Gesamtkostenquote<br>(TER)/synthetische<br>TER |  | Anteile in Umlauf<br>31. März 2024 | Nettoinventarwert je Anteil* |                    |                    |
|---------------------------------|--|--|------------------------------------|------------------------------|--------------------|--------------------|
|                                 | 31. März 2024<br>(siehe Erläuterung 15)        |  |                                    | 31. März 2024                | 31. März 2023      | 31. März 2022      |
| <b>GEM Debt Total Return</b>    |  |  |                                    |                              |                    |                    |
| USD                             |  |  |                                    |                              |                    |                    |
| BC                              | 1,15 %   |  | 4.223,345                          | 9,82                         | 9,00               | 9,32               |
| BCH EUR                         | 1,18 %   |  | 9.678,048                          | 9,51                         | 8,95               | 9,77               |
| BDH EUR**                       | -  |  | -                                  | -                            | -                  | 8,76               |
| FC                              | 0,69 %   |  | 75.000,000                         | 15,10                        | 13,78              | 14,18              |
| L1C                             | 0,75 %   |  | 426.142,465                        | 15,91                        | 14,53              | 14,97              |
| L1C EUR                         | 0,75 %   |  | 167.226,997                        | 13,67                        | 12,48              | 12,86              |
| L1CH CHF                        | 0,77 %   |  | 27.197,000                         | 9,30                         | 8,73               | 9,25               |
| L1CH EUR                        | 0,77 %   |  | 1.147.745,181                      | 9,84                         | 9,23               | 10,03              |
| L1D                             | 0,75 %   |  | 2.018,971                          | 10,62                        | 10,17              | 10,94              |
| L1DH EUR                        | 0,77 %   |  | 483.131,151                        | 6,80                         | 6,68               | 7,66               |
| M1C                             | 1,35 %   |  | 467.977,762                        | 14,85                        | 13,64              | 14,14              |
| M1C EUR                         | 1,35 %   |  | 9.395,990                          | 13,57                        | 12,46              | 12,92              |
| M1CH EUR                        | 1,38 %   |  | 295.289,194                        | 9,33                         | 8,79               | 9,61               |
| M1D                             | 1,35 %   |  | 100.958,832                        | 10,37                        | 9,92               | 10,69              |
| M1D EUR                         | 1,35 %   |  | 30.906,464                         | 10,35                        | 9,91               | 10,67              |
| M1DH EUR                        | 1,38 %   |  | 6.609,891                          | 7,84                         | 7,69               | 8,79               |
| N1C                             | 0,85 %   |  | 11.200,000                         | 10,22                        | 9,34               | 9,63               |
| N1CH EUR                        | 0,87 %   |  | 466,818                            | 9,12                         | 8,56               | 9,31               |
| N1DH EUR                        | 0,87 %   |  | 15.796,000                         | 7,79                         | 7,65               | 8,76               |
| R1CH EUR**                      | -  |  | -                                  | -                            | -                  | 9,57               |
| S21DH EUR**                     | -  |  | -                                  | -                            | -                  | 8,22               |
| XDH EUR**                       | -  |  | -                                  | -                            | -                  | 8,97               |
| ZC**                            | -  |  | -                                  | -                            | -                  | 8,80               |
| ZDH EUR**                       | -  |  | -                                  | -                            | -                  | 8,79               |
| <b>Gesamtnettovermögen</b>      |  |  |                                    | <b>36.771.045</b>            | <b>125.663.112</b> | <b>296.726.158</b> |
| <b>Global Bond</b>              |  |  |                                    |                              |                    |                    |
| USD                             |  |  |                                    |                              |                    |                    |
| AC                              | 1,00 %   |  | 70.877,596                         | 16,25                        | 16,41              | 18,08              |
| AD                              | 1,00 %   |  | 375.074,837                        | 11,96                        | 12,24              | 13,54              |
| AM2                             | 1,00 %   |  | 57.184,940                         | 10,30                        | -                  | -                  |
| AM2 HKD                         | 1,00 %   |  | 1.525.715,375                      | 1,05                         | 1,10               | 1,24               |
| EC                              | 1,30 %   |  | 14.386,112                         | 12,07                        | 12,22              | 13,51              |
| IC                              | 0,53 %   |  | 408.808,201                        | 17,62                        | 17,71              | 19,42              |
| PD                              | 0,75 %   |  | 107.038,431                        | 9,76                         | 9,99               | 11,05              |
| WC GBP                          | 0,00 %   |  | 370.224,769                        | 16,66                        | 16,65              | 18,17              |
| ZC**                            | -  |  | -                                  | -                            | -                  | 18,42              |
| ZD                              | 0,15 %   |  | 1.226.636,450                      | 12,31                        | 12,60              | 13,96              |
| <b>Gesamtnettovermögen</b>      |  |  |                                    | <b>37.494.374</b>            | <b>37.000.893</b>  | <b>44.611.096</b>  |
| <b>Global Bond Total Return</b> |  |  |                                    |                              |                    |                    |
| USD                             |  |  |                                    |                              |                    |                    |
| AC                              | 1,15 %   |  | 99.583,690                         | 10,93                        | 10,38              | 11,32              |
| BC                              | 0,70 %   |  | 63.009,699                         | 9,23                         | 8,72               | 9,47               |
| BCH GBP                         | 0,82 %   |  | 72,440                             | 11,43                        | 10,65              | 12,42              |
| IC                              | 0,65 %   |  | 153.879,505                        | 11,44                        | 10,80              | 11,72              |
| ICH EUR**                       | -  |  | -                                  | -                            | 9,51               | 10,83              |
| ICH GBP                         | 0,68 %   |  | 158,817                            | 11,97                        | 11,13              | 12,98              |
| IQ1H EUR                        | 0,67 %   |  | 105,995                            | 8,98                         | 9,19               | 10,54              |
| IQ1H GBP                        | 0,66 %   |  | 105,976                            | 10,94                        | 10,73              | 12,59              |
| S15CH GBP                       | 0,17 %   |  | 72,440                             | 11,60                        | 10,74              | 12,45              |
| WCH GBP                         | 0,02 %   |  | 1.123.959,600                      | 13,93                        | 12,88              | 14,91              |
| XC                              | 0,55 %   |  | 500,000                            | 11,54                        | 10,89              | 11,81              |
| XCH EUR                         | 0,46 %   |  | 100,000                            | 9,88                         | 9,55               | 10,87              |
| XCH GBP                         | 0,57 %   |  | 224.299,451                        | 12,01                        | 11,17              | 13,00              |
| XQ1H GBP                        | 0,43 %   |  | 105,972                            | 11,00                        | 10,77              | 12,61              |
| ZC                              | 0,16 %   |  | 13.370.000,000                     | 11,93                        | 11,21              | 12,11              |
| ZQ1                             | 0,15 %   |  | 170.621,000                        | 8,78                         | 8,70               | 9,46               |
| ZQ1H GBP                        | 0,17 %   |  | 3.466.000,219                      | 10,88                        | 10,62              | 12,40              |
| <b>Gesamtnettovermögen</b>      |  |  |                                    | <b>220.498.021</b>           | <b>191.309.646</b> | <b>245.779.656</b> |

\* Nettoinventarwert je Anteil mit Swing-Korrektur (siehe Erläuterung 14),

\*\* Die Anteilsklassen sind zum 31. März 2024 inaktiv,

Der Nettoinventarwert je Anteil ist stets in der Währung des Teilfonds angegeben.

# Wichtige Kennzahlen

zum 31. März 2024

| Teilfonds                               | Gesamtkostenquote<br>(TER)/synthetische<br>TER |  | Anteile in Umlauf<br>31. März 2024 | Nettoinventarwert je Anteil* |                      |                      |
|---|--|--|------------------------------------|------------------------------|----------------------|----------------------|
|   | 31. März 2024<br>(siehe Erläuterung 15)        |  |                                    | 31. März 2024                | 31. März 2023        | 31. März 2022        |
| <b>Global Corporate Bond USD</b>        |  |  |                                    |                              |                      |                      |
| BC                                      | 0,63 %   |  | 3.008,122                          | 11,20                        | 10,54                | 11,24                |
| BCH EUR**                               | -  |  | -                                  | -                            | 12,57                | -                    |
| BQ1H GBP                                | 0,65 %   |  | 82.641,048                         | 10,86                        | 10,45                | 12,38                |
| ICH EUR                                 | 0,60 %   |  | 10.772,742                         | 10,62                        | 10,24                | 11,49                |
| ZBFIX8.5H JPY**                         | -  |  | -                                  | -                            | 51,12                | 67,45                |
| ZC                                      | 0,10 %   |  | 3.453.686,068                      | 11,61                        | 10,87                | 11,53                |
| ZCH EUR                                 | 0,13 %   |  | 10.672.714,973                     | 11,10                        | 10,66                | 11,91                |
| ZD                                      | 0,11 %   |  | 3.611.553,246                      | 10,65                        | 10,25                | 11,14                |
| ZDH GBP                                 | 0,21 %   |  | 608,597                            | 12,14                        | 11,49                | 13,50                |
| ZM1H JPY**                              | -  |  | -                                  | -                            | 63,42                | 78,82                |
| ZQ1                                     | 0,10 %   |  | 190.148.154,232                    | 10,20                        | 9,91                 | 10,83                |
| ZQ1H AUD                                | 0,14 %   |  | 652.742,071                        | 6,04                         | 6,12                 | 7,60                 |
| ZQ1H CHF                                | 0,21 %   |  | 931.126,330                        | 8,86                         | 8,86                 | 9,97                 |
| ZQ1H EUR                                | 0,14 %   |  | 20.171.869,421                     | 9,03                         | 9,00                 | 10,36                |
| ZQ1H GBP                                | 0,13 %   |  | 80.005.795,232                     | 11,86                        | 11,35                | 13,37                |
| ZQ1H JPY**                              | -  |  | -                                  | -                            | 64,00                | 79,68                |
| ZQ1H SGD                                | 0,13 %   |  | 6.128.456,611                      | 6,73                         | 6,76                 | 7,31                 |
| <b>Gesamtnettovermögen</b>              |  |  |                                    | <b>3.321.464.616</b>         | <b>2.564.709.922</b> | <b>3.175.404.930</b> |
| <b>Global Emerging Markets Bond USD</b> |  |  |                                    |                              |                      |                      |
| AC                                      | 1,60 %   |  | 371.076,139                        | 34,66                        | 31,30                | 34,58                |
| AC EUR                                  | 1,60 %   |  | 3.145,000                          | 13,86                        | 12,52                | 13,83                |
| AC GBP                                  | 1,60 %   |  | 3.157,507                          | 18,91                        | 17,07                | 18,86                |
| AC HKD                                  | 1,60 %   |  | 104.492,418                        | 1,32                         | 1,19                 | 1,32                 |
| ACH CHF                                 | 1,46 %   |  | 16,833                             | 9,15                         | 8,47                 | 9,56                 |
| ACH EUR                                 | 1,63 %   |  | 43.868,403                         | 8,87                         | 8,22                 | 9,60                 |
| AD                                      | 1,60 %   |  | 80.342,050                         | 22,18                        | 20,89                | 23,88                |
| AD GBP                                  | 1,60 %   |  | 881,323                            | 12,49                        | 11,77                | 13,46                |
| ADH EUR                                 | 1,63 %   |  | 41.045,425                         | 9,63                         | 9,31                 | 11,30                |
| AM2                                     | 1,60 %   |  | 1.707.631,330                      | 14,57                        | 14,28                | 17,14                |
| AM2 HKD                                 | 1,60 %   |  | 18.233.574,849                     | 0,74                         | 0,72                 | 0,86                 |
| AM3H AUD                                | 1,63 %   |  | 1.230.534,241                      | 3,33                         | 3,36                 | 4,55                 |
| AM3H EUR                                | 1,63 %   |  | 201.050,249                        | 5,39                         | 5,32                 | 6,58                 |
| AM3H SGD                                | 1,63 %   |  | 612.818,782                        | 3,79                         | 3,78                 | 4,47                 |
| BC                                      | 0,98 %   |  | 4.987,446                          | 10,88                        | 9,76                 | 10,72                |
| BC GBP                                  | 0,98 %   |  | 13.528,457                         | 17,43                        | 15,64                | 17,17                |
| BCH EUR                                 | 1,00 %   |  | 21.770,990                         | 9,43                         | 8,69                 | 10,08                |
| BD GBP                                  | 0,98 %   |  | 19.003,972                         | 11,40                        | 10,74                | 12,30                |
| BQ1H GBP                                | 1,00 %   |  | 19.279,126                         | 10,20                        | 9,65                 | -                    |
| EC                                      | 1,90 %   |  | 168.618,202                        | 32,90                        | 29,80                | 33,03                |
| ECH EUR                                 | 1,93 %   |  | 2.071,308                          | 9,39                         | 8,73                 | 10,21                |
| ED                                      | 1,90 %   |  | 3.234,608                          | 18,34                        | 17,27                | 19,73                |
| FC EUR                                  | 0,38 %   |  | 253.600,000                        | 12,07                        | 10,77                | -                    |
| IC                                      | 0,75 %   |  | 343.350,846                        | 39,92                        | 35,75                | 39,16                |
| IC EUR                                  | 0,75 %   |  | 11.584,836                         | 16,81                        | 15,05                | 16,49                |
| ICH CHF                                 | 0,78 %   |  | 4.730,000                          | 9,55                         | 8,79                 | 9,92                 |
| ICH EUR                                 | 0,77 %   |  | 2.189.927,706                      | 17,12                        | 15,73                | 18,20                |
| ID**                                    | -  |  | -                                  | -                            | 14,98                | 17,18                |
| ID EUR                                  | 0,75 %   |  | 2.534.828,575                      | 9,74                         | 9,18                 | 10,52                |
| IDH EUR                                 | 0,77 %   |  | 3.850.846,520                      | 9,86                         | 9,53                 | 11,62                |
| PC                                      | 1,35 %   |  | 427.288,446                        | 35,83                        | 32,28                | 35,57                |
| PD                                      | 1,35 %   |  | 428.231,694                        | 14,49                        | 13,65                | 15,62                |
| XC                                      | 0,62 %   |  | 603.311,827                        | 40,69                        | 36,39                | 39,80                |
| XDH EUR                                 | 0,64 %   |  | 1.248.510,047                      | 10,23                        | 9,89                 | 12,10                |
| ZBFIX8.5H JPY**                         | -  |  | -                                  | -                            | 44,73                | 60,68                |
| ZC                                      | 0,12 %   |  | 1.767.775,028                      | 11,64                        | 10,36                | 11,27                |
| ZCH EUR                                 | 0,15 %   |  | 3.444.467,437                      | 9,77                         | 8,92                 | 10,26                |
| ZD                                      | 0,12 %   |  | 333.837,795                        | 16,30                        | 15,37                | 17,66                |
| ZM1H JPY**                              | -  |  | -                                  | -                            | 47,31                | 62,09                |
| ZQ1                                     | 0,12 %   |  | 61.531.220,974                     | 7,47                         | 7,11                 | 8,20                 |
| ZQ1H AUD                                | 0,21 %   |  | 80.769,173                         | 4,78                         | 4,76                 | 6,27                 |
| ZQ1H CHF                                | 0,22 %   |  | 224.749,061                        | 6,62                         | 6,49                 | 7,71                 |
| ZQ1H EUR                                | 0,15 %   |  | 3.730.646,508                      | 6,62                         | 6,47                 | 7,88                 |
| ZQ1H GBP                                | 0,15 %   |  | 26.511.373,830                     | 8,69                         | 8,15                 | 10,16                |
| ZQ1H JPY**                              | -  |  | -                                  | -                            | 47,78                | 62,87                |
| ZQ1H SGD                                | 0,16 %   |  | 711.832,725                        | 5,01                         | 4,94                 | 5,64                 |
| <b>Gesamtnettovermögen</b>              |  |  |                                    | <b>1.023.505.006</b>         | <b>1.172.999.393</b> | <b>1.682.091.114</b> |

\* Nettoinventarwert je Anteil mit Swing-Korrektur (siehe Erläuterung 14),

\*\* Die Anteilsklassen sind zum 31. März 2024 inaktiv,

Der Nettoinventarwert je Anteil ist stets in der Währung des Teilfonds angegeben.

# Wichtige Kennzahlen

zum 31. März 2024

| Teilfonds  | Gesamtkostenquote<br>(TER)/synthetische<br>TER |  | Anteile in Umlauf<br>31. März 2024 | Nettoinventarwert je Anteil* |               |               |
|--|--|--|------------------------------------|------------------------------|---------------|---------------|
|  | 31. März 2024<br>(siehe Erläuterung 15)        |  |                                    | 31. März 2024                | 31. März 2023 | 31. März 2022 |
| Global Emerging Markets Corporate Sustainable Bond USD |  |  |                                    |                              |               |               |
| AC   | 1,60 %   |  | 1.000,000                          | 11,52                        | 10,56         | -             |
| ACH EUR  | 1,61 %   |  | 90,580                             | 11,48                        | -             | -             |
| AD   | 1,60 %   |  | 1.000,000                          | 11,19                        | 10,56         | -             |
| IC   | 0,88 %   |  | 1.000,000                          | 11,65                        | 10,60         | -             |
| ID   | 0,88 %   |  | 1.000,000                          | 11,27                        | 10,60         | -             |
| XC   | 0,69 %   |  | 12.217.249,517                     | 11,68                        | 10,61         | -             |
| ZQ1  | 0,25 %   |  | 2.352,979                          | 10,56                        | 10,25         | -             |
| Gesamtnettovermögen                                    |  |  |                                    | 142.782.734                  | 112.217.456   | -             |
| Global Emerging Markets ESG Bond USD                   |  |  |                                    |                              |               |               |
| AC   | 1,65 %   |  | 100,000                            | 9,30                         | 8,52          | 9,23          |
| XC   | 0,62 %   |  | 100,000                            | 9,52                         | 8,63          | 9,25          |
| ZCH EUR  | 0,26 %   |  | 1.559.075,062                      | 11,57                        | 10,72         | -             |
| ZQ1  | 0,20 %   |  | 5.364.459,340                      | 8,21                         | 7,93          | 8,98          |
| ZQ1H EUR   | 0,27 %   |  | 119.174,522                        | 9,92                         | 9,83          | -             |
| ZQ1H GBP   | 0,25 %   |  | 1.938.693,852                      | 11,42                        | 10,87         | -             |
| Gesamtnettovermögen                                    |  |  |                                    | 85.392.364                   | 100.352.835   | 57.648.927    |
| Global Emerging Markets ESG Local Debt USD             |  |  |                                    |                              |               |               |
| AC   | 1,60 %   |  | 500,000                            | 8,92                         | 8,52          | 8,53          |
| BC GBP   | 0,97 %   |  | 300,000                            | 15,54                        | 14,75         | 14,67         |
| EC   | 1,91 %   |  | 1.409,842                          | 8,65                         | 8,29          | 8,32          |
| ECO EUR  | 1,93 %   |  | 1.463,647                          | 8,78                         | 8,65          | 9,19          |
| FC   | 0,51 %   |  | 140.885,000                        | 10,90                        | 10,30         | -             |
| IC   | 0,88 %   |  | 226.004,000                        | 9,62                         | 9,12          | 9,06          |
| IC EUR   | 0,88 %   |  | 331.703,675                        | 12,40                        | 11,76         | 11,68         |
| XC   | 0,77 %   |  | 2.471.157,680                      | 12,23                        | 11,59         | -             |
| ZC   | 0,17 %   |  | 3.839.961,474                      | 10,02                        | 9,44          | 9,31          |
| ZC EUR   | 0,21 %   |  | 2.195.498,631                      | 11,82                        | 11,13         | 10,98         |
| ZM1HJPY  | 0,27 %   |  | 1.297,565                          | 64,95                        | -             | -             |
| ZD   | 0,19 %   |  | 10.939.951,992                     | 7,57                         | 7,52          | 7,84          |
| ZQ1  | 0,17 %   |  | 10.790.518,761                     | 8,87                         | 8,94          | 9,34          |
| Gesamtnettovermögen                                    |  |  |                                    | 281.103.263                  | 292.675.167   | 202.368.836   |
| Global Emerging Markets Local Debt USD                 |  |  |                                    |                              |               |               |
| AC   | 1,60 %   |  | 1.119.846,327                      | 12,83                        | 12,41         | 12,42         |
| AC EUR   | 1,60 %   |  | 54.475,114                         | 11,62                        | 11,24         | 11,25         |
| AC GBP   | 1,60 %   |  | 1.584,257                          | 14,44                        | 13,97         | 13,98         |
| AD   | 1,60 %   |  | 72.231,802                         | 8,55                         | 8,50          | 8,61          |
| BC   | 0,98 %   |  | 20.455,772                         | 10,85                        | 10,43         | 10,37         |
| BC GBP   | 0,98 %   |  | 4.118,104                          | 15,49                        | 14,89         | 14,81         |
| BD GBP   | 0,98 %   |  | 556,969                            | 11,01                        | 10,95         | 11,10         |
| BQ1  | 0,98 %   |  | 8.712,657                          | 10,15                        | 10,49         | -             |
| EC   | 1,90 %   |  | 13.663,159                         | 12,28                        | 11,91         | 11,96         |
| ECO EUR  | 1,93 %   |  | 37.713,734                         | 8,78                         | 8,76          | 9,29          |
| IC   | 0,88 %   |  | 564.687,688                        | 14,46                        | 13,89         | 13,79         |
| IC EUR   | 0,88 %   |  | 267.623,021                        | 12,52                        | 12,03         | 11,95         |
| ICO EUR  | 0,90 %   |  | 14.827,136                         | 8,23                         | 8,12          | 8,48          |
| ICO GBP**  | -  |  | -                                  | -                            | 11,20         | 12,03         |
| ID   | 0,88 %   |  | 38.251,498                         | 8,83                         | 8,78          | 8,90          |
| ID EUR   | 0,88 %   |  | 3.658.516,338                      | 9,18                         | 9,13          | 9,25          |
| XC   | 0,76 %   |  | 429.339,195                        | 9,35                         | 8,97          | 8,90          |
| XCO EUR  | 0,76 %   |  | 15.800.804,086                     | 9,75                         | 9,61          | 10,08         |
| XD   | 0,74 %   |  | 3.746.761,963                      | 6,85                         | 6,81          | 6,91          |
| ZBFIX8.5 JPY   | 0,25 %   |  | 5.464,531                          | 63,52                        | 65,96         | 70,86         |
| ZC   | 0,13 %   |  | 4.233.406,099                      | 11,05                        | 10,54         | 10,39         |
| ZD   | 0,22 %   |  | 746.411,924                        | 8,44                         | 8,40          | 8,53          |
| ZM2  | 0,23 %   |  | 1.068.770,805                      | 7,17                         | 7,31          | 7,64          |
| ZQ1  | 0,13 %   |  | 78.795.449,191                     | 7,76                         | 7,95          | 8,19          |
| Gesamtnettovermögen                                    |  |  |                                    | 918.136.089                  | 1.274.054.242 | 1.131.996.157 |

\* Nettoinventarwert je Anteil mit Swing-Korrektur (siehe Erläuterung 14),

\*\* Die Anteilsklassen sind zum 31. März 2024 inaktiv,

Der Nettoinventarwert je Anteil ist stets in der Währung des Teilfonds angegeben.

# Wichtige Kennzahlen

zum 31. März 2024

| Teilfonds                     | Gesamtkostenquote<br>(TER)/synthetische<br>TER |  | Anteile in Umlauf<br>31. März 2024 | Nettoinventarwert je Anteil* |               |               |
|-------------------------------|--|--|------------------------------------|------------------------------|---------------|---------------|
|                               | 31. März 2024<br>(siehe Erläuterung 15)        |  |                                    | 31. März 2024                | 31. März 2023 | 31. März 2022 |
| Global ESG Corporate Bond USD |  |  |                                    |                              |               |               |
| IC                            | 0,57 %   |  | 100,000                            | 9,43                         | 8,90          | 9,47          |
| ZQ1                           | 0,15 %   |  | 14.033.673,303                     | 8,90                         | 8,64          | 9,38          |
| ZQ1H EUR                      | 0,19 %   |  | 325.499,000                        | 9,09                         | 9,06          | 10,36         |
| ZQ1H GBP                      | 0,19 %   |  | 4.791.056,673                      | 11,02                        | 10,53         | 12,33         |
| Gesamtnettvermögen            |  |  |                                    | 180.622.487                  | 188.903.671   | 203.593.794   |
| Global Government Bond USD    |  |  |                                    |                              |               |               |
| BCH EUR                       | 0,57 %   |  | 2.637,000                          | 9,87                         | 9,93          | 11,07         |
| BQ1H GBP                      | 0,30 %   |  | 15.317,876                         | 11,91                        | 11,32         | -             |
| ICH EUR                       | 0,52 %   |  | 12.790,835                         | 9,76                         | 9,95          | 11,07         |
| ZBFIX8.5H JPY**               | -  |  | -                                  | -                            | 50,75         | 66,51         |
| ZC                            | 0,10 %   |  | 5.824.803,000                      | 10,48                        | 10,36         | 10,93         |
| ZD                            | 0,10 %   |  | 8.109.391,392                      | 10,83                        | 10,85         | 11,51         |
| ZM1H JPY**                    | -  |  | -                                  | -                            | 65,55         | 79,66         |
| ZQ1                           | 0,10 %   |  | 279.180.375,422                    | 9,91                         | 10,03         | 10,72         |
| ZQ1H AUD                      | 0,14 %   |  | 1.057.278,604                      | 6,04                         | 6,38          | 7,73          |
| ZQ1H CHF                      | 0,21 %   |  | 1.614.171,856                      | 8,81                         | 9,18          | 10,08         |
| ZQ1H EUR                      | 0,13 %   |  | 38.023.524,243                     | 9,00                         | 9,35          | 10,51         |
| ZQ1H GBP                      | 0,13 %   |  | 78.818.377,199                     | 11,65                        | 11,61         | 13,36         |
| ZQ1H JPY**                    | -  |  | -                                  | -                            | 65,44         | 79,59         |
| ZQ1H SGD                      | 0,13 %   |  | 9.748.049,194                      | 6,81                         | 7,13          | 7,53          |
| Gesamtnettvermögen            |  |  |                                    | 4.262.528.516                | 2.962.519.709 | 2.292.079.924 |
| Global Green Bond USD         |  |  |                                    |                              |               |               |
| AC                            | 1,00 %   |  | 100.000,000                        | 9,27                         | 8,69          | 9,47          |
| IC                            | 0,58 %   |  | 100.000,000                        | 9,36                         | 8,73          | 9,48          |
| XC                            | 0,48 %   |  | 100.000,000                        | 9,38                         | 8,74          | 9,48          |
| ZC                            | 0,20 %   |  | 100.000,000                        | 9,44                         | 8,77          | 9,49          |
| ZQ1                           | 0,20 %   |  | 4.539.166,732                      | 8,99                         | 8,61          | 9,49          |
| ZQ1H EUR                      | 0,22 %   |  | 91.332,000                         | 10,90                        | -             | -             |
| ZQ1H GBP                      | 0,22 %   |  | 1.288.544,061                      | 12,92                        | -             | -             |
| Gesamtnettvermögen            |  |  |                                    | 62.172.128                   | 26.633.159    | 29.702.296    |
| Global High Income Bond USD   |  |  |                                    |                              |               |               |
| AC                            | 1,50 %   |  | 1.963.516,443                      | 15,82                        | 14,78         | 16,01         |
| ACH CAD                       | 1,53 %   |  | 98.566,845                         | 7,85                         | 7,39          | 8,71          |
| ACH EUR                       | 1,53 %   |  | 307.866,807                        | 11,25                        | 10,78         | 12,30         |
| ACH GBP                       | 1,53 %   |  | 125.834,557                        | 12,86                        | 11,83         | 13,82         |
| ACH SGD                       | 1,53 %   |  | 227.941,088                        | 10,52                        | 10,16         | 10,88         |
| AD                            | 1,50 %   |  | 226.245,835                        | 11,68                        | 11,20         | 12,44         |
| ADH EUR                       | 1,53 %   |  | 10.686,775                         | 8,34                         | 8,20          | 9,62          |
| AM2                           | 1,50 %   |  | 80.920.937,807                     | 8,04                         | 8,09          | 9,42          |
| AM3H AUD                      | 1,53 %   |  | 22.328.143,079                     | 4,74                         | 4,91          | 6,44          |
| AM3H EUR                      | 1,53 %   |  | 1.468.951,493                      | 7,81                         | 7,91          | 9,46          |
| AM3H RMB                      | 1,53 %   |  | 23.557.453,848                     | 1,06                         | 1,13          | 1,42          |
| AM3H SGD                      | 1,53 %   |  | 3.632.714,913                      | 6,05                         | 6,19          | 7,09          |
| BC**                          | -  |  | -                                  | -                            | 10,17         | 10,95         |
| BCH EUR**                     | -  |  | -                                  | -                            | 9,82          | 11,14         |
| BD**                          | -  |  | -                                  | -                            | 8,88          | 9,87          |
| EC                            | 1,80 %   |  | 28.408,147                         | 12,14                        | 11,38         | 12,36         |
| ECH EUR                       | 1,83 %   |  | 2.956,943                          | 10,95                        | 10,53         | 12,05         |
| IC                            | 0,83 %   |  | 128.897,238                        | 13,96                        | 12,96         | 13,95         |
| ICH EUR                       | 0,85 %   |  | 333.395,194                        | 12,46                        | 11,86         | 13,45         |
| ID                            | 0,83 %   |  | 144.414,266                        | 9,37                         | 8,99          | 10,00         |
| IM2                           | 0,83 %   |  | 1.189.249,160                      | 8,31                         | 8,31          | 9,61          |
| XDH EUR                       | 0,49 %   |  | 1.000.000,000                      | 8,96                         | 8,82          | 10,38         |
| Gesamtnettvermögen            |  |  |                                    | 885.592.682                  | 789.795.418   | 1.035.452.172 |

\* Nettoinventarwert je Anteil mit Swing-Korrektur (siehe Erläuterung 14),

\*\* Die Anteilsklassen sind zum 31. März 2024 inaktiv,

Der Nettoinventarwert je Anteil ist stets in der Währung des Teilfonds angegeben.

# Wichtige Kennzahlen

zum 31. März 2024

| Teilfonds   | Gesamtkostenquote<br>(TER)/synthetische<br>TER |  | Anteile in Umlauf<br>31. März 2024 | Nettoinventarwert je Anteil* |                      |                      |
|---|--|--|------------------------------------|------------------------------|----------------------|----------------------|
|   | 31. März 2024<br>(siehe Erläuterung 15)        |  |                                    | 31. März 2024                | 31. März 2023        | 31. März 2022        |
| Global High Yield Bond<br>USD                       |  |  |                                    |                              |                      |                      |
| AC  | 1,35 %   |  | 372.799,079                        | 12,82                        | 11,77                | 12,56                |
| ACH CAD   | 1,38 %   |  | 47.651,672                         | 8,60                         | 7,95                 | 9,24                 |
| ACH GBP   | 1,38 %   |  | 84.718,616                         | 14,26                        | 12,89                | 14,83                |
| AD  | 1,35 %   |  | 24.439,415                         | 9,25                         | 8,90                 | 9,93                 |
| AM2   | 1,35 %   |  | 7.739.645,038                      | 7,68                         | 7,67                 | 8,87                 |
| AM2 HKD   | 1,35 %   |  | 49.097.710,490                     | 0,99                         | 0,99                 | 1,14                 |
| AM3H AUD  | 1,38 %   |  | 2.069.146,894                      | 4,93                         | 5,06                 | 6,60                 |
| AM3H EUR  | 1,38 %   |  | 648.108,206                        | 8,06                         | 8,10                 | 9,63                 |
| AM3H RMB  | 1,38 %   |  | 1.498.336,063                      | 1,08                         | 1,14                 | 1,43                 |
| BC**  | -  |  | -                                  | -                            | -                    | 10,09                |
| BD GBP  | 0,80 %   |  | 7.109,824                          | 11,77                        | 11,37                | 12,70                |
| BQ1H GBP  | 0,82 %   |  | 3.547,379                          | 45,41                        | 43,49                | -                    |
| EC**  | -  |  | -                                  | -                            | -                    | 12,36                |
| ECH EUR   | 1,68 %   |  | 317,137                            | 11,74                        | 11,09                | 12,51                |
| IC  | 0,75 %   |  | 200.581,597                        | 13,58                        | 12,39                | 13,15                |
| ICH EUR   | 0,77 %   |  | 493.073,700                        | 12,62                        | 11,82                | 13,21                |
| ID  | 0,75 %   |  | 4.327,331                          | 9,29                         | 8,95                 | 10,00                |
| ZBFIX8.5H JPY                                       | 0,22 %   |  | 1.962,310                          | 44,99                        | 53,67                | 70,17                |
| ZC  | 0,13 %   |  | 5.837.809,786                      | 14,56                        | 13,21                | 13,93                |
| ZCH EUR   | 0,17 %   |  | 424.630,953                        | 11,95                        | 11,12                | 12,35                |
| ZD  | 0,17 %   |  | 440.456,296                        | 9,46                         | 9,12                 | 10,08                |
| ZDH GBP   | 0,22 %   |  | 2.465,195                          | 10,66                        | 10,09                | 12,28                |
| ZM1H JPY  | 0,16 %   |  | 102.031,824                        | 48,95                        | 57,12                | 72,56                |
| ZQ1   | 0,13 %   |  | 40.007.412,897                     | 8,92                         | 8,62                 | 9,66                 |
| ZQ1H AUD  | 0,19 %   |  | 26.146,097                         | 5,39                         | 5,44                 | 6,95                 |
| ZQ1H CHF  | 0,21 %   |  | 56.220,000                         | 8,06                         | 8,01                 | 9,23                 |
| ZQ1H EUR  | 0,16 %   |  | 2.443.430,594                      | 8,02                         | 7,95                 | 9,39                 |
| ZQ1H GBP  | 0,16 %   |  | 9.825.411,134                      | 10,18                        | 9,68                 | 11,71                |
| ZQ1H JPY  | 0,15 %   |  | 131.719,027                        | 51,55                        | 60,17                | 76,68                |
| ZQ1H SGD  | 0,16 %   |  | 207.136,514                        | 6,02                         | 6,02                 | 6,68                 |
| <b>Gesamtnettovermögen</b>                          |  |  |                                    | <b>725.384.222</b>           | <b>1.109.671.579</b> | <b>1.584.396.209</b> |
| Global High Yield ESG Bond<br>USD                   |  |  |                                    |                              |                      |                      |
| ACH CHF   | 1,37 %   |  | 450,000                            | 9,99                         | 9,42                 | 10,19                |
| ACH EUR   | 1,37 %   |  | 413,000                            | 10,01                        | 9,42                 | 10,45                |
| ACH GBP   | 1,38 %   |  | 355,000                            | 12,13                        | 10,97                | 12,44                |
| ICH CHF   | 0,78 %   |  | 1.000,000                          | 10,15                        | 9,52                 | 10,24                |
| ICH EUR   | 0,78 %   |  | 1.000,000                          | 10,17                        | 9,52                 | 10,50                |
| ICH GBP   | 0,78 %   |  | 1.000,000                          | 12,34                        | 11,08                | 12,50                |
| ZC  | 0,20 %   |  | 1.000,000                          | 10,12                        | 9,18                 | 9,56                 |
| ZQ1   | 0,20 %   |  | 2.671.720,484                      | 8,96                         | 8,64                 | 9,55                 |
| ZQ1H EUR  | 0,22 %   |  | 60.919,000                         | 9,94                         | 9,83                 | -                    |
| ZQ1H GBP  | 0,22 %   |  | 858.404,753                        | 11,72                        | 11,12                | -                    |
| <b>Gesamtnettovermögen</b>                          |  |  |                                    | <b>34.667.130</b>            | <b>40.685.992</b>    | <b>55.975.177</b>    |
| Global High Yield Securitised Credit<br>Bond<br>USD |  |  |                                    |                              |                      |                      |
| AC  | 1,75 %   |  | 28.608,494                         | 12,08                        | 10,42                | 10,50                |
| IC  | 0,95 %   |  | 204.661,273                        | 12,71                        | 10,87                | 10,87                |
| XC  | 0,85 %   |  | 2.810.358,867                      | 14,61                        | 12,49                | 12,47                |
| XCH JPY   | 0,87 %   |  | 48.781,438                         | 71,69                        | 74,69                | 81,92                |
| ZC  | 0,17 %   |  | 117.082,439                        | 240,84                       | 204,47               | 202,75               |
| ZCH EUR   | 0,19 %   |  | 450.608,867                        | 12,17                        | 10,47                | 10,84                |
| ZQ1H JPY  | 0,23 %   |  | 2.541,145                          | 66,31                        | -                    | -                    |
| <b>Gesamtnettovermögen</b>                          |  |  |                                    | <b>81.349.414</b>            | <b>128.096.185</b>   | <b>176.306.522</b>   |

\* Nettoinventarwert je Anteil mit Swing-Korrektur (siehe Erläuterung 14),

\*\* Die Anteilsklassen sind zum 31. März 2024 inaktiv,

Der Nettoinventarwert je Anteil ist stets in der Währung des Teilfonds angegeben.

# Wichtige Kennzahlen

zum 31. März 2024

| Teilfonds  | Gesamtkostenquote<br>(TER)/synthetische<br>TER |  | Anteile in Umlauf<br>31. März 2024 | Nettoinventarwert je Anteil* |                      |                      |
|--|--|--|------------------------------------|------------------------------|----------------------|----------------------|
|  | 31. März 2024<br>(siehe Erläuterung 15)        |  |                                    | 31. März 2024                | 31. März 2023        | 31. März 2022        |
| <b>Global Inflation Linked Bond USD</b>                    |  |  |                                    |                              |                      |                      |
| AC   | 0,95 %   |  | 15.833,942                         | 144,25                       | 144,52               | 155,65               |
| ACH EUR  | 0,97 %   |  | 86.216,535                         | 130,41                       | 134,14               | 151,99               |
| AD   | 0,95 %   |  | 21.882,079                         | 10,56                        | 11,19                | 12,43                |
| EC   | 1,25 %   |  | 5.806,691                          | 138,82                       | 139,49               | 150,68               |
| ECH EUR  | 1,28 %   |  | 447.256,251                        | 11,07                        | 11,42                | 12,98                |
| IC   | 0,55 %   |  | 772,977                            | 152,39                       | 152,08               | 163,13               |
| ICH EUR  | 0,57 %   |  | 9.331,046                          | 138,40                       | 141,79               | 160,00               |
| PCH EUR  | 0,31 %   |  | 4.986.112,733                      | 10,69                        | 10,93                | 12,30                |
| S17C   | 0,32 %   |  | 1.696.333,167                      | 11,60                        | 11,55                | 12,36                |
| YC   | 0,74 %   |  | 4.047,008                          | 11,25                        | 11,24                | 12,08                |
| YCH EUR  | 0,76 %   |  | 362.191,551                        | 10,43                        | 10,71                | 12,11                |
| ZC   | 0,15 %   |  | 335.944,029                        | 11,31                        | 11,24                | 12,01                |
| ZCH EUR**  | -  |  | -                                  | -                            | -                    | 12,47                |
| ZQ1  | 0,11 %   |  | 32.313.338,142                     | 9,59                         | 9,86                 | 11,24                |
| ZQ1H CHF   | 0,17 %   |  | 94.291,000                         | 10,22                        | 10,80                | -                    |
| ZQ1H EUR   | 0,14 %   |  | 3.505.838,626                      | 8,92                         | 9,40                 | 11,29                |
| ZQ1H GBP   | 0,13 %   |  | 11.981.183,061                     | 11,20                        | 11,33                | 13,94                |
| ZQ1H JPY**   | -  |  | -                                  | -                            | 70,40                | -                    |
| ZQ1H SGD   | 0,14 %   |  | 815.965,156                        | 7,26                         | 7,72                 | 8,03                 |
| <b>Gesamtnettovermögen</b>                                 |  |  |                                    | <b>583.828.984</b>           | <b>642.492.437</b>   | <b>216.528.713</b>   |
| <b>Global Investment Grade Securitised Credit Bond USD</b> |  |  |                                    |                              |                      |                      |
| AC   | 1,15 %   |  | 73.009,471                         | 11,27                        | 10,44                | 10,38                |
| ACH EUR  | 1,18 %   |  | 185,531                            | 10,88                        | 10,33                | 10,79                |
| ACH SGD  | 1,17 %   |  | 4.851,613                          | 8,00                         | 7,65                 | 7,51                 |
| ADH EUR  | 1,17 %   |  | 164.914,658                        | 10,28                        | 10,00                | 10,48                |
| AM2  | 1,15 %   |  | 38.541.520,122                     | 9,28                         | 9,18                 | 9,51                 |
| AM2 HKD  | 1,15 %   |  | 215.492.184,005                    | 1,18                         | 1,17                 | 1,21                 |
| AM3H AUD   | 1,17 %   |  | 7.325.438,611                      | 6,34                         | 6,44                 | 7,48                 |
| AM3H GBP   | 1,17 %   |  | 2.711.570,707                      | 12,58                        | 12,18                | -                    |
| AM3H JPY   | 1,13 %   |  | 14,940                             | 66,17                        | -                    | -                    |
| AM3H RMB   | 1,17 %   |  | 21.558.681,554                     | 1,28                         | 1,34                 | 1,50                 |
| AM3H SGD   | 1,18 %   |  | 1.472,991                          | 6,98                         | 6,98                 | 7,09                 |
| BCH EUR  | 0,72 %   |  | 27.400,531                         | 11,15                        | 10,54                | 10,96                |
| BCH GBP**  | -  |  | -                                  | -                            | -                    | 13,43                |
| BDH EUR  | 0,72 %   |  | 19.847,000                         | 10,32                        | 10,04                | 10,53                |
| BQ1H GBP   | 0,72 %   |  | 433.411,334                        | 11,74                        | 11,29                | 12,44                |
| IC   | 0,65 %   |  | 2.719.519,321                      | 11,58                        | 10,67                | 10,56                |
| XC   | 0,57 %   |  | 1.599.443,319                      | 11,04                        | 10,16                | 10,05                |
| XCH EUR  | 0,58 %   |  | 62.964,000                         | 11,12                        | 10,49                | 10,90                |
| XCH GBP  | 0,58 %   |  | 6.798.488,475                      | 14,01                        | 12,69                | 13,46                |
| XCH JPY**  | -  |  | -                                  | -                            | -                    | 81,84                |
| ZBFIX8.5H JPY  | 0,22 %   |  | 7.245,125                          | 47,04                        | 56,63                | 68,85                |
| ZC   | 0,10 %   |  | 1.803.038,832                      | 172,03                       | 157,69               | 155,22               |
| ZCH GBP  | 0,11 %   |  | 6.248.688,574                      | 13,15                        | -                    | -                    |
| ZM1H JPY   | 0,13 %   |  | 296.769,350                        | 56,43                        | 66,15                | 76,39                |
| ZQ1  | 0,11 %   |  | 28.445.209,010                     | 9,97                         | 9,69                 | 9,89                 |
| ZQ1H AUD   | 0,16 %   |  | 89.183,267                         | 6,25                         | 6,33                 | 7,32                 |
| ZQ1H CHF   | 0,16 %   |  | 155.957,247                        | 9,77                         | 9,75                 | 10,21                |
| ZQ1H GBP   | 0,14 %   |  | 25.780.823,866                     | 12,02                        | 11,49                | 12,60                |
| ZQ1H SGD   | 0,14 %   |  | 817.655,913                        | 7,14                         | 7,17                 | 7,22                 |
| ZQ2H EUR   | 0,15 %   |  | 4.075.270,981                      | 9,55                         | 9,60                 | 10,38                |
| <b>Gesamtnettovermögen</b>                                 |  |  |                                    | <b>1.923.537.811</b>         | <b>1.289.266.469</b> | <b>1.585.352.570</b> |

\* Nettoinventarwert je Anteil mit Swing-Korrektur (siehe Erläuterung 14),

\*\* Die Anteilsklassen sind zum 31. März 2024 inaktiv,

Der Nettoinventarwert je Anteil ist stets in der Währung des Teilfonds angegeben.

# Wichtige Kennzahlen

zum 31. März 2024

| Teilfonds                                 | Gesamtkostenquote<br>(TER)/synthetische<br>TER |  | Anteile in Umlauf<br>31. März 2024 | Nettoinventarwert je Anteil* |                    |                    |
|---|--|--|------------------------------------|------------------------------|--------------------|--------------------|
|   | 31. März 2024<br>(siehe Erläuterung 15)        |  |                                    | 31. März 2024                | 31. März 2023      | 31. März 2022      |
| <b>Global Lower Carbon Bond USD</b>       |  |  |                                    |                              |                    |                    |
| AC  | 1,05 %   |  | 558.226,674                        | 10,92                        | 10,31              | 11,06              |
| ACH EUR                                   | 1,08 %   |  | 988.714,132                        | 10,46                        | 10,13              | 11,43              |
| ACH GBP                                   | 1,08 %   |  | 146.143,005                        | 11,74                        | 10,91              | 12,61              |
| AD  | 1,05 %   |  | 44.433,038                         | 10,26                        | 9,83               | 10,64              |
| ADH EUR                                   | 1,08 %   |  | 16.544,439                         | 9,10                         | 8,94               | 10,20              |
| AM2                                       | 1,05 %   |  | 11.897.316,828                     | 8,96                         | 8,97               | 10,08              |
| AM2 HKD                                   | 1,05 %   |  | 45.449.647,892                     | 1,14                         | 1,14               | 1,28               |
| AM3H AUD                                  | 1,08 %   |  | 382.256,579                        | 5,32                         | 5,48               | 6,93               |
| AM3H SGD                                  | 1,07 %   |  | 421.710,591                        | 6,07                         | 6,18               | 6,83               |
| BC  | 0,65 %   |  | 16.183,180                         | 9,32                         | 8,77               | 9,37               |
| BCH EUR**                                 | -  |  | -                                  | -                            | -                  | 10,96              |
| BCH GBP                                   | 0,67 %   |  | 82.066,455                         | 12,16                        | 11,26              | 12,96              |
| IC  | 0,60 %   |  | 151.668,352                        | 9,98                         | 9,38               | 10,02              |
| XC  | 0,50 %   |  | 568.505,000                        | 11,32                        | 10,63              | 11,34              |
| ZQ1                                       | 0,18 %   |  | 3.890.270,793                      | 10,19                        | 9,84               | 10,74              |
| ZQ1H CHF                                  | 0,22 %   |  | 49.981,857                         | 9,03                         | 8,98               | 10,06              |
| ZQ1H EUR                                  | 0,22 %   |  | 108.480,000                        | 9,10                         | 9,03               | 10,37              |
| ZQ1H GBP                                  | 0,22 %   |  | 1.491.582,552                      | 11,48                        | 10,93              | 12,85              |
| <b>Gesamtnettvermögen</b>                 |  |  |                                    | <b>248.760.932</b>           | <b>154.546.381</b> | <b>205.076.831</b> |
| <b>Global Securitised Credit Bond USD</b> |  |  |                                    |                              |                    |                    |
| AC**                                      | -  |  | -                                  | -                            | 10,18              | 10,15              |
| IC  | 0,85 %   |  | 36.959,000                         | 11,83                        | 10,52              | 10,42              |
| XC**                                      | -  |  | -                                  | -                            | -                  | 9,79               |
| XCH GBP                                   | 0,77 %   |  | 150.481,230                        | 14,04                        | 12,17              | 12,91              |
| XCH JPY                                   | 0,77 %   |  | 310.119,101                        | 66,78                        | 72,37              | 78,66              |
| XD  | 0,75 %   |  | 1.100.000,000                      | 10,15                        | 9,45               | 9,56               |
| XDH GBP                                   | 0,77 %   |  | 553.397,452                        | 12,98                        | 11,77              | 12,79              |
| ZCH EUR                                   | 0,22 %   |  | 461.628,123                        | 11,56                        | 10,36              | 10,62              |
| ZQ1                                       | 0,20 %   |  | 3.944.333,252                      | 9,34                         | 8,91               | 9,25               |
| ZQ1H EUR                                  | 0,22 %   |  | 25.038,000                         | 11,01                        | -                  | -                  |
| ZQ1H GBP                                  | 0,22 %   |  | 441.045,565                        | 12,08                        | 11,25              | 12,53              |
| ZQ1H JPY                                  | 0,23 %   |  | 4.577,576                          | 66,40                        | -                  | -                  |
| <b>Gesamtnettvermögen</b>                 |  |  |                                    | <b>89.672.521</b>            | <b>80.739.259</b>  | <b>130.141.948</b> |
| <b>Global Short Duration Bond USD</b>     |  |  |                                    |                              |                    |                    |
| AC  | 0,70 %   |  | 484.237,084                        | 11,60                        | 10,97              | 11,19              |
| AC SGD                                    | 0,70 %   |  | 39.821,237                         | 8,52                         | 8,06               | 8,23               |
| ACH SGD                                   | 0,72 %   |  | 82.329,068                         | 8,12                         | 7,94               | 8,00               |
| AM2                                       | 0,70 %   |  | 110.881.261,563                    | 9,56                         | 9,61               | 10,31              |
| AM2 HKD                                   | 0,70 %   |  | 630.367.953,121                    | 1,22                         | 1,23               | 1,32               |
| AM3H AUD                                  | 0,72 %   |  | 19.239.953,853                     | 6,20                         | 6,40               | 7,71               |
| AM3H CAD                                  | 0,72 %   |  | 4.985.374,294                      | 7,56                         | -                  | -                  |
| AM3H EUR                                  | 0,72 %   |  | 1.177.640,061                      | 11,03                        | -                  | -                  |
| AM3H GBP                                  | 0,72 %   |  | 2.752.031,911                      | 12,93                        | -                  | -                  |
| AM3H JPY                                  | 0,73 %   |  | 14,940                             | 66,06                        | -                  | -                  |
| AM3H RMB                                  | 0,72 %   |  | 79.672.800,572                     | 1,31                         | 1,39               | 1,62               |
| IC  | 0,43 %   |  | 245.637,568                        | 11,88                        | 11,20              | 11,40              |
| ICH EUR                                   | 0,45 %   |  | 147.982,677                        | 10,65                        | 10,29              | 11,00              |
| S16CH GBP                                 | 0,28 %   |  | 6.888.700,000                      | 12,96                        | 12,01              | 13,10              |
| XC  | 0,31 %   |  | 500,000                            | 12,00                        | 11,31              | 11,49              |
| XCH EUR**                                 | -  |  | -                                  | -                            | 10,30              | 11,00              |
| ZC  | 0,12 %   |  | 529.425,408                        | 12,20                        | 11,47              | 11,64              |
| ZQ1**                                     | -  |  | -                                  | -                            | 9,88               | 9,93               |
| ZQ1H GBP                                  | 0,17 %   |  | 48.084,105                         | 12,00                        | 11,62              | 12,98              |
| <b>Gesamtnettvermögen</b>                 |  |  |                                    | <b>2.248.054.320</b>         | <b>826.600.095</b> | <b>356.558.146</b> |

\* Nettoinventarwert je Anteil mit Swing-Korrektur (siehe Erläuterung 14),

\*\* Die Anteilsklassen sind zum 31. März 2024 inaktiv,

Der Nettoinventarwert je Anteil ist stets in der Währung des Teilfonds angegeben.

# Wichtige Kennzahlen

zum 31. März 2024

| Teilfonds                 | Gesamtkostenquote<br>(TER)/synthetische<br>TER |  | Anteile in Umlauf<br>31. März 2024 | Nettoinventarwert je Anteil* |                    |                    |
|---------------------------|--|--|------------------------------------|------------------------------|--------------------|--------------------|
|                           | 31. März 2024<br>(siehe Erläuterung 15)        |  |                                    | 31. März 2024                | 31. März 2023      | 31. März 2022      |
| India Fixed Income<br>USD |  |  |                                    |                              |                    |                    |
| AC                        | 1,45 %   |  | 1.112.273,547                      | 13,52                        | 12,93              | 13,72              |
| AC EUR                    | 1,45 %   |  | 104.126,894                        | 16,69                        | 15,96              | 16,94              |
| AC SGD                    | 1,45 %   |  | 16.853,223                         | 8,73                         | 8,35               | 8,86               |
| AD                        | 1,45 %   |  | 806.592,548                        | 7,76                         | 7,80               | 8,70               |
| AM2                       | 1,45 %   |  | 40.633.782,005                     | 6,67                         | 6,86               | 7,83               |
| AM2 HKD                   | 1,45 %   |  | 169.694.294,344                    | 1,01                         | 1,04               | 1,19               |
| AM30 AUD                  | 1,48 %   |  | 5.572.968,741                      | 5,13                         | 5,42               | 6,95               |
| AM30 CAD                  | 1,47 %   |  | 364.010,692                        | 7,41                         | -                  | -                  |
| AM30 EUR                  | 1,48 %   |  | 1.110.093,492                      | 8,48                         | 8,79               | 10,28              |
| AM30 GBP                  | 1,47 %   |  | 699.934,653                        | 12,68                        | -                  | -                  |
| AM30 JPY                  | 1,47 %   |  | 14,940                             | 65,94                        | -                  | -                  |
| AM30 RMB                  | 1,48 %   |  | 38.749.040,166                     | 1,09                         | 1,18               | 1,46               |
| AM30 SGD                  | 1,48 %   |  | 1.839.950,329                      | 4,90                         | 5,12               | 5,74               |
| BC                        | 0,90 %   |  | 364.502,969                        | 13,20                        | 12,55              | 13,24              |
| BC EUR**                  | -  |  | -                                  | -                            | -                  | 13,52              |
| BD                        | 0,90 %   |  | 262.294,752                        | 8,89                         | 8,93               | 9,97               |
| BD GBP                    | 0,90 %   |  | 109.490,837                        | 13,27                        | 13,33              | 14,88              |
| EC                        | 1,75 %   |  | 371.810,615                        | 12,45                        | 11,94              | 12,71              |
| IC                        | 0,80 %   |  | 985.985,575                        | 14,58                        | 13,85              | 14,61              |
| IC CHF                    | 0,80 %   |  | 10.500,003                         | 13,26                        | 12,59              | 13,28              |
| IC EUR                    | 0,80 %   |  | 2.203.318,467                      | 17,70                        | 16,81              | 17,73              |
| IC GBP**                  | -  |  | -                                  | -                            | 13,79              | 14,54              |
| ID                        | 0,80 %   |  | 201.849,371                        | 8,50                         | 8,53               | 9,53               |
| ID EUR                    | 0,80 %   |  | 76.926,981                         | 9,47                         | 9,51               | 10,62              |
| ID GBP                    | 0,80 %   |  | 6.597,535                          | 10,33                        | 10,37              | 11,58              |
| IM2                       | 0,80 %   |  | 748.320,351                        | 7,45                         | 7,61               | 8,63               |
| XC                        | 0,66 %   |  | 5.817.716,601                      | 12,08                        | 11,46              | 12,06              |
| XCO EUR                   | 0,72 %   |  | 160.542,663                        | 12,39                        | 12,02              | 13,24              |
| XD                        | 0,67 %   |  | 2.561.916,634                      | 8,47                         | 8,51               | 9,50               |
| XM2                       | 0,68 %   |  | 3.905.200,000                      | 7,26                         | 7,42               | 8,39               |
| ZD                        | 0,17 %   |  | 4.201.297,130                      | 8,91                         | 8,96               | 10,01              |
| <b>Gesamtnetovermögen</b> |  |  |                                    | <b>801.073.698</b>           | <b>536.054.875</b> | <b>662.544.643</b> |

\* Nettoinventarwert je Anteil mit Swing-Korrektur (siehe Erläuterung 14),

\*\* Die Anteilsklassen sind zum 31. März 2024 inaktiv,

Der Nettoinventarwert je Anteil ist stets in der Währung des Teilfonds angegeben.



# Wichtige Kennzahlen

zum 31. März 2024

| Teilfonds                               | Gesamtkostenquote<br>(TER)/synthetische<br>TER |  | Anteile in Umlauf<br>31. März 2024 | Nettoinventarwert je Anteil* |                    |                    |
|---|--|--|------------------------------------|------------------------------|--------------------|--------------------|
|   | 31. März 2024<br>(siehe Erläuterung 15)        |  |                                    | 31. März 2024                | 31. März 2023      | 31. März 2022      |
| <b>RMB Fixed Income USD</b>             |  |  |                                    |                              |                    |                    |
| AC                                      | 1,00 %   |  | 546.793,694                        | 12,56                        | 12,84              | 13,78              |
| AC EUR                                  | 1,00 %   |  | 189.074,244                        | 16,47                        | 16,85              | 18,07              |
| AC RMB                                  | 1,00 %   |  | 18.636.207,323                     | 1,96                         | 2,00               | 2,15               |
| ACO EUR                                 | 1,03 %   |  | 54.630,148                         | 10,76                        | 11,29              | 12,78              |
| ACO SGD                                 | 1,03 %   |  | 7.224,274                          | 7,24                         | 7,65               | 8,13               |
| AD                                      | 1,00 %   |  | 210.031,954                        | 8,93                         | 9,38               | 10,37              |
| AD EUR                                  | 1,00 %   |  | 194.028,993                        | 11,97                        | 12,58              | 13,91              |
| AM2                                     | 1,00 %   |  | 4.343.150,126                      | 8,50                         | 9,04               | 10,16              |
| AM2 HKD                                 | 1,10 %   |  | 865,685                            | 1,03                         | 1,09               | 1,23               |
| AM2 RMB                                 | 1,00 %   |  | 24.060.717,281                     | 1,22                         | 1,30               | 1,46               |
| AM30 SGD                                | 1,03 %   |  | 620.941,864                        | 6,20                         | 6,71               | 7,43               |
| BC                                      | 0,63 %   |  | 11.520,281                         | 11,67                        | 11,89              | 12,70              |
| BD GBP**                                | -  |  | -                                  | -                            | -                  | 15,76              |
| EC                                      | 1,30 %   |  | 149.263,763                        | 12,06                        | 12,37              | 13,31              |
| ECO EUR                                 | 1,33 %   |  | 356.680,745                        | 10,27                        | 10,81              | 12,26              |
| IC                                      | 0,58 %   |  | 1.753.372,219                      | 13,24                        | 13,48              | 14,40              |
| IC EUR                                  | 0,58 %   |  | 80.547,191                         | 16,06                        | 16,35              | 17,47              |
| IC RMB                                  | 0,58 %   |  | 516.681,178                        | 11,29                        | 11,49              | 12,28              |
| ICO EUR                                 | 0,60 %   |  | 1.234.098,502                      | 11,21                        | 11,71              | 13,19              |
| ID                                      | 0,58 %   |  | 1.000,000                          | 8,61                         | 9,06               | 10,03              |
| IM2                                     | 0,58 %   |  | 396.838,602                        | 9,93                         | -                  | 9,81               |
| XD**                                    | -  |  | -                                  | -                            | -                  | 14,06              |
| XD EUR                                  | 0,50 %   |  | 4.007.600,000                      | 9,91                         | 10,27              | -                  |
| XD10 EUR                                | 0,52 %   |  | 264.600,000                        | 8,93                         | 9,70               | 11,01              |
| ZC                                      | 0,18 %   |  | 162.028,597                        | 11,29                        | 11,45              | 12,18              |
| <b>Gesamtnettovermögen</b>              |  |  |                                    | <b>219.054.212</b>           | <b>269.969.776</b> | <b>392.041.420</b> |
| <b>Singapore Dollar Income Bond SGD</b> |  |  |                                    |                              |                    |                    |
| AC                                      | 1,00 %   |  | 2.349.024,797                      | 10,20                        | 9,70               | 10,22              |
| ACH AUD                                 | 1,02 %   |  | 376.172,368                        | 8,42                         | 8,09               | 9,79               |
| AM2                                     | 1,00 %   |  | 19.739.578,390                     | 7,98                         | 8,01               | 8,87               |
| AM3H AUD                                | 1,02 %   |  | 1.069.057,374                      | 7,04                         | 7,14               | 9,04               |
| AM3H USD                                | 1,02 %   |  | 5.357.642,480                      | 10,81                        | 10,69              | 12,04              |
| IC                                      | 0,50 %   |  | 77.898,774                         | 10,51                        | 9,95               | 10,43              |
| <b>Gesamtnettovermögen</b>              |  |  |                                    | <b>250.954.948</b>           | <b>192.593.971</b> | <b>241.717.313</b> |
| <b>Ultra Short Duration Bond USD</b>    |  |  |                                    |                              |                    |                    |
| AC                                      | 0,55 %   |  | 81.265,830                         | 10,88                        | 10,24              | 9,98               |
| BC                                      | 0,35 %   |  | 50.366,396                         | 10,93                        | 10,26              | 9,98               |
| BM2                                     | 0,35 %   |  | 393.409,093                        | 9,92                         | 9,84               | 9,94               |
| BM3H GBP                                | 0,37 %   |  | 1.794.707,706                      | 12,52                        | 12,16              | 13,07              |
| IC                                      | 0,35 %   |  | 665.861,448                        | 10,65                        | 10,00              | -                  |
| PC                                      | 0,45 %   |  | 36.575.169,845                     | 10,92                        | 10,26              | 9,99               |
| PC HKD                                  | 0,45 %   |  | 73.462.435,540                     | 1,40                         | 1,32               | 1,29               |
| PCH AUD                                 | 0,47 %   |  | 2.689.935,521                      | 6,95                         | 6,79               | 7,48               |
| PCH GBP                                 | 0,47 %   |  | 796.198,376                        | 13,61                        | 12,57              | 13,14              |
| PCH RMB                                 | 0,47 %   |  | 6.160.446,558                      | 1,48                         | 1,51               | 1,60               |
| PM2                                     | 0,45 %   |  | 10.790.396,498                     | 9,91                         | 9,84               | 9,93               |
| PM2 HKD                                 | 0,45 %   |  | 36.193.255,038                     | 1,28                         | 1,27               | 1,28               |
| PM3H AUD                                | 0,47 %   |  | 1.622.662,164                      | 6,47                         | 6,59               | 7,46               |
| PM3H EUR                                | 0,47 %   |  | 11.325,822                         | 10,79                        | 10,77              | 11,03              |
| PM3H GBP                                | 0,47 %   |  | 463.921,289                        | 12,53                        | 12,17              | 13,09              |
| PM3H RMB                                | 0,47 %   |  | 2.686.443,649                      | 1,37                         | 1,44               | 1,57               |
| PM3H SGD                                | 0,47 %   |  | 2.909.722,912                      | 7,34                         | 7,39               | 7,34               |
| UC**                                    | -  |  | -                                  | -                            | 10,27              | 9,99               |
| UM2                                     | 0,30 %   |  | 16.558.262,381                     | 10,01                        | 9,94               | -                  |
| UM2 HKD                                 | 0,30 %   |  | 12.556.969,128                     | 1,28                         | 1,27               | -                  |
| XC                                      | 0,26 %   |  | 215.186,859                        | 10,46                        | -                  | -                  |
| XCH EUR                                 | 0,30 %   |  | 735.336,878                        | 11,46                        | 11,01              | -                  |
| XCH GBP                                 | 0,28 %   |  | 3.628.913,481                      | 13,66                        | 12,60              | 13,14              |
| ZM                                      | 0,11 %   |  | 6.881.009,290                      | 10,15                        | 9,99               | 9,95               |
| <b>Gesamtnettovermögen</b>              |  |  |                                    | <b>1.082.463.123</b>         | <b>764.078.587</b> | <b>830.545.882</b> |

\* Nettoinventarwert je Anteil mit Swing-Korrektur (siehe Erläuterung 14),

\*\* Die Anteilsklassen sind zum 31. März 2024 inaktiv,

Der Nettoinventarwert je Anteil ist stets in der Währung des Teilfonds angegeben.

# Wichtige Kennzahlen

zum 31. März 2024

| Teilfonds  | Gesamtkostenquote<br>(TER)/synthetische<br>TER |  | Anteile in Umlauf<br>31. März 2024 | Nettoinventarwert je Anteil* |                    |                    |
|--|--|--|------------------------------------|------------------------------|--------------------|--------------------|
|  | 31. März 2024<br>(siehe Erläuterung 15)        |  |                                    | 31. März 2024                | 31. März 2023      | 31. März 2022      |
| <b>US Dollar Bond USD</b>  |  |  |                                    |                              |                    |                    |
| AC   | 1,00 %   |  | 103.763,094                        | 16,14                        | 16,03              | 17,13              |
| AD   | 1,00 %   |  | 114.429,263                        | 9,89                         | 10,01              | 10,81              |
| AM2  | 1,00 %   |  | 26.832.221,363                     | 8,01                         | 8,35               | 9,34               |
| AM2 HKD  | 1,00 %   |  | 6.532.727,431                      | 10,25                        | 10,69              | 11,95              |
| AM3H CAD   | 1,02 %   |  | 640.262,968                        | 7,54                         | -                  | -                  |
| AM3H EUR   | 1,02 %   |  | 107.536,131                        | 11,01                        | -                  | -                  |
| AM3H GBP   | 1,02 %   |  | 335.190,234                        | 12,91                        | -                  | -                  |
| EC   | 1,30 %   |  | 4.743,923                          | 15,32                        | 15,26              | 16,35              |
| IC   | 0,53 %   |  | 491.784,501                        | 17,30                        | 17,10              | 18,18              |
| ID   | 0,53 %   |  | 16.984,000                         | 14,13                        | 14,32              | 15,47              |
| PD   | 0,75 %   |  | 249.842,770                        | 9,92                         | 10,05              | 10,86              |
| WD   | 0,00 %   |  | 231,933                            | 10,01                        | 10,14              | 10,97              |
| ZC   | 0,15 %   |  | 219.430,446                        | 18,93                        | 18,63              | 19,74              |
| ZD   | 0,15 %   |  | 2.288.382,755                      | 10,47                        | 10,60              | 11,46              |
| <b>Gesamtnettovermögen</b>                                       |  |  |                                    | <b>334.451.312</b>           | <b>126.475.751</b> | <b>82.977.554</b>  |
| <b>US High Yield Bond USD</b>                                    |  |  |                                    |                              |                    |                    |
| AC   | 1,35 %   |  | 15.892,509                         | 11,54                        | 10,64              | 11,52              |
| AM2  | 1,35 %   |  | 538.476,543                        | 8,18                         | 8,18               | 9,59               |
| AM2 HKD  | 1,35 %   |  | 4.376.610,403                      | 1,04                         | 1,04               | 1,22               |
| AM3H AUD   | 1,38 %   |  | 54.547,433                         | 5,23                         | 5,39               | 7,13               |
| AM3H RMB   | 1,38 %   |  | 3.048.227,979                      | 1,12                         | 1,19               | 1,51               |
| AQ1  | 1,36 %   |  | 680,362                            | 8,32                         | 8,20               | 9,49               |
| IC   | 0,69 %   |  | 500,000                            | 11,96                        | 10,95              | 11,78              |
| IQ1  | 0,69 %   |  | 680,629                            | 8,62                         | 8,44               | 9,71               |
| XC   | 0,65 %   |  | 1.000,000                          | 11,98                        | 10,97              | 11,79              |
| XQ1  | 0,64 %   |  | 680,653                            | 8,64                         | 8,46               | 9,72               |
| ZC   | 0,20 %   |  | 2.470.531,145                      | 12,28                        | 11,20              | 11,98              |
| ZD   | 0,20 %   |  | 644,767                            | 9,46                         | 9,21               | 10,48              |
| ZQ1  | 0,19 %   |  | 680,827                            | 8,85                         | 8,63               | 9,87               |
| <b>Gesamtnettovermögen</b>                                       |  |  |                                    | <b>43.236.951</b>            | <b>46.163.625</b>  | <b>63.733.408</b>  |
| <b>US Short Duration High Yield Bond*** USD</b>                  |  |  |                                    |                              |                    |                    |
| AC   | 1,15 %   |  | 175.499,637                        | 14,11                        | 13,03              | 13,40              |
| ACH EUR  | 1,18 %   |  | 268.782,473                        | 12,42                        | 11,76              | 12,74              |
| AD   | 1,15 %   |  | 32.322,843                         | 9,87                         | 9,56               | 10,32              |
| ADH EUR  | 1,18 %   |  | 373.953,292                        | 8,93                         | 8,86               | 10,14              |
| EC   | 1,55 %   |  | 61.782,853                         | 13,13                        | 12,18              | 12,58              |
| ECH EUR  | 1,58 %   |  | 172.793,512                        | 11,72                        | 11,14              | 12,11              |
| ED   | 1,55 %   |  | 18.781,749                         | 9,75                         | 9,44               | 10,18              |
| IC   | 0,65 %   |  | 135.827,863                        | 14,90                        | 13,69              | 14,01              |
| IC EUR   | 0,65 %   |  | 296.855,623                        | 17,66                        | 16,23              | 16,61              |
| ICH EUR  | 0,67 %   |  | 173.934,240                        | 13,07                        | 12,32              | 13,28              |
| ZC   | 0,20 %   |  | 9.336,834                          | 15,66                        | 14,33              | 14,60              |
| ZQ1  | 0,20 %   |  | 6.104.555,777                      | 9,33                         | 9,08               | 9,82               |
| ZQ1H CHF   | 0,22 %   |  | 29.591,000                         | 8,41                         | 8,42               | 9,35               |
| ZQ1H EUR   | 0,22 %   |  | 1.614.461,603                      | 8,59                         | 8,58               | 9,77               |
| ZQ1H GBP   | 0,22 %   |  | 26.433,892                         | 10,90                        | 10,44              | 12,17              |
| ZQ1H JPY**   | -  |  | -                                  | -                            | -                  | 74,62              |
| ZQ1H SGD   | 0,22 %   |  | 3.700,598                          | 6,53                         | 6,57               | 7,03               |
| <b>Gesamtnettovermögen</b>                                       |  |  |                                    | <b>93.567.859</b>            | <b>103.256.574</b> | <b>164.859.347</b> |
| <b>Euro Convertible Bond (geschlossen zum 23. März 2023) EUR</b> |  |  |                                    |                              |                    |                    |
| AC   | -  |  | -                                  | -                            | -                  | 9,45               |
| ID   | -  |  | -                                  | -                            | -                  | 9,75               |
| YC   | -  |  | -                                  | -                            | -                  | 9,54               |
| <b>Gesamtnettovermögen</b>                                       |  |  |                                    |                              |                    | <b>14.272.036</b>  |

\* Nettoinventarwert je Anteil mit Swing-Korrektur (siehe Erläuterung 14),

\*\* Die Anteilsklassen sind zum 31. März 2024 inaktiv,

\*\*\* Bis zum 2. Juli 2023 lautete der Name des Teilfonds „Global Short Duration High Yield Bond“, Der Nettoinventarwert je Anteil ist stets in der Währung des Teilfonds angegeben.

# Wichtige Kennzahlen

zum 31. März 2024

| Teilfonds   | Gesamtkostenquote<br>(TER)/synthetische<br>TER |                                    | Nettoinventarwert je Anteil* |               |               |
|---|--|------------------------------------|------------------------------|---------------|---------------|
|   | 31. März 2024<br>(siehe Erläuterung 15)        | Anteile in Umlauf<br>31. März 2024 | 31. März 2024                | 31. März 2023 | 31. März 2022 |
| Global Credit Floating Rate Fixed<br>Term Bond 2022 – 1 (geschlossen<br>zum 10. Januar 2023)<br>USD   |  |                                    |                              |               |               |
| AC  | -  | -                                  | -                            | -             | 10,07         |
| ACH EUR   | -  | -                                  | -                            | -             | 10,53         |
| AQ2   | -  | -                                  | -                            | -             | 9,06          |
| AQ3H AUD  | -  | -                                  | -                            | -             | 6,77          |
| AQ3H EUR  | -  | -                                  | -                            | -             | 10,01         |
| BQ3H GBP  | -  | -                                  | -                            | -             | 11,83         |
| Gesamtnettovermögen   |  |                                    |                              |               | 112.544.292   |
| Global Credit Floating Rate Fixed<br>Term Bond 2023 – 1 (geschlossen<br>zum 5. Juli 2023)<br>USD      |  |                                    |                              |               |               |
| AC  | -  | -                                  | -                            | 10,39         | 10,16         |
| AM2   | -  | -                                  | -                            | 9,09          | 9,37          |
| AM3H EUR  | -  | -                                  | -                            | 9,88          | 10,42         |
| AM3H SGD  | -  | -                                  | -                            | 6,83          | 6,91          |
| BC  | -  | -                                  | -                            | 10,46         | 10,21         |
| BM2   | -  | -                                  | -                            | 9,09          | 9,37          |
| BM3H EUR  | -  | -                                  | -                            | 9,88          | 10,41         |
| BM3H GBP  | -  | -                                  | -                            | 11,18         | 12,27         |
| PC  | -  | -                                  | -                            | 10,42         | 10,18         |
| PM2   | -  | -                                  | -                            | 9,09          | 9,37          |
| PM3H EUR  | -  | -                                  | -                            | -             | 10,41         |
| PM3H GBP  | -  | -                                  | -                            | 11,14         | 12,23         |
| PM3H RMB  | -  | -                                  | -                            | 1,32          | 1,47          |
| PM3H SGD  | -  | -                                  | -                            | -             | 6,91          |
| Gesamtnettovermögen   |  |                                    |                              | 557.703.344   | 674.105.946   |
| Global Credit Floating Rate Fixed<br>Term Bond 2023 - 2 (geschlossen<br>zum 29. Dezember 2023)<br>USD |  |                                    |                              |               |               |
| AC  | -  | -                                  | -                            | 10,55         | 10,34         |
| ACH SGD   | -  | -                                  | -                            | 7,83          | 7,57          |
| AM2   | -  | -                                  | -                            | 9,37          | 9,66          |
| AM3H EUR  | -  | -                                  | -                            | 10,17         | 10,74         |
| AM3H SGD  | -  | -                                  | -                            | 7,03          | 7,13          |
| BC  | -  | -                                  | -                            | 10,62         | 10,39         |
| BM2   | -  | -                                  | -                            | 9,37          | 9,66          |
| BM3H GBP  | -  | -                                  | -                            | 11,53         | 12,67         |
| PC  | -  | -                                  | -                            | 10,58         | 10,36         |
| PM2   | -  | -                                  | -                            | 9,37          | 9,66          |
| PM2 HKD   | -  | -                                  | -                            | 1,20          | 1,23          |
| PM3H AUD  | -  | -                                  | -                            | 6,24          | 7,22          |
| Gesamtnettovermögen   |  |                                    |                              | 394.326.735   | 520.765.151   |
| Global Emerging Markets Multi-Asset<br>Income<br>USD  |  |                                    |                              |               |               |
| AC  | 1,71 %   | 13.823,504                         | 9,86                         | 9,34          | 9,80          |
| AM2   | 1,71 %   | 4.060.597,172                      | 6,94                         | 7,02          | 7,85          |
| AM2 HKD   | 1,71 %   | 13.264.334,077                     | 0,89                         | 0,90          | 1,00          |
| AM3O AUD  | 1,74 %   | 541.968,896                        | 4,37                         | 4,56          | 5,75          |
| AM3O EUR  | 1,74 %   | 211.836,688                        | 7,32                         | 7,47          | 8,60          |
| AM3O GBP  | 1,74 %   | 347.875,169                        | 8,53                         | 8,47          | 10,14         |
| AM3O RMB  | 1,74 %   | 494.808,278                        | 0,97                         | 1,04          | 1,27          |
| AM3O SGD  | 1,74 %   | 341,137                            | 5,72                         | 5,89          | 6,49          |
| Gesamtnettovermögen   |  |                                    | 47.481.092                   | 53.475.476    | 71.895.531    |
| Managed Solutions – Asia Focused<br>Conservative<br>USD   |  |                                    |                              |               |               |
| AC  | 1,12 %   | 491.665,571                        | 12,53                        | 12,23         | 12,89         |
| AC HKD  | 1,12 %   | 623.821,656                        | 1,62                         | 1,58          | 1,66          |
| ACO AUD   | 1,15 %   | 104.621,692                        | 8,25                         | 8,40          | 10,05         |
| ACO EUR   | 1,15 %   | 224.303,751                        | 11,22                        | 11,24         | 12,46         |
| ACO SGD   | 1,14 %   | 2.261,535                          | 8,82                         | 8,90          | 9,28          |
| AM2   | 1,12 %   | 1.685.742,835                      | 8,75                         | 9,06          | 10,13         |
| AM2 HKD   | 1,12 %   | 5.807.889,142                      | 1,13                         | 1,17          | 1,31          |
| AM3O RMB  | 1,15 %   | 302.556,625                        | 1,17                         | 1,28          | 1,55          |
| Gesamtnettovermögen   |  |                                    | 32.275.418                   | 47.888.112    | 49.559.220    |

\* Nettoinventarwert je Anteil mit Swing-Korrektur (siehe Erläuterung 14),  
Der Nettoinventarwert je Anteil ist stets in der Währung des Teilfonds angegeben.

# Wichtige Kennzahlen

zum 31. März 2024

| Teilfonds                                   | Gesamtkostenquote<br>(TER)/synthetische<br>TER |  | Anteile in Umlauf<br>31. März 2024 | Nettoinventarwert je Anteil* |                      |                      |
|---|--|--|------------------------------------|------------------------------|----------------------|----------------------|
|   | 31. März 2024<br>(siehe Erläuterung 15)        |  |                                    | 31. März 2024                | 31. März 2023        | 31. März 2022        |
| Managed Solutions – Asia Focused Growth USD |  |  |                                    |                              |                      |                      |
| AC  | 1,88 %   |  | 929.731,982                        | 11,53                        | 11,39                | 12,96                |
| AC HKD                                      | 1,88 %   |  | 2.538.806,841                      | 1,49                         | 1,47                 | 1,67                 |
| ACO AUD                                     | 1,91 %   |  | 218.021,817                        | 7,19                         | 7,43                 | 9,68                 |
| ACO EUR                                     | 1,91 %   |  | 74.340,665                         | 10,17                        | 10,31                | 12,41                |
| ACO SGD                                     | 1,90 %   |  | 3.053,681                          | 7,97                         | 8,14                 | 9,19                 |
| AM2   | 1,89 %   |  | 195.131,021                        | 7,77                         | 7,99                 | 9,49                 |
| <b>Gesamtnettovermögen</b>                  |  |  |                                    | <b>18.353.768</b>            | <b>27.686.618</b>    | <b>36.273.663</b>    |
| Managed Solutions – Asia Focused Income USD |  |  |                                    |                              |                      |                      |
| AC  | 1,60 %   |  | 201.587,030                        | 12,08                        | 11,71                | 12,79                |
| ACO EUR**                                   | -  |  | -                                  | -                            | -                    | 10,13                |
| ACO SGD                                     | 1,63 %   |  | 577.706,689                        | 8,45                         | 8,48                 | 9,16                 |
| AM2   | 1,60 %   |  | 14.288.161,312                     | 8,04                         | 8,26                 | 9,57                 |
| AM2 HKD                                     | 1,60 %   |  | 102.807.737,718                    | 1,04                         | 1,06                 | 1,23                 |
| AM30 AUD                                    | 1,63 %   |  | 6.215.838,970                      | 4,55                         | 4,81                 | 6,29                 |
| AM30 CAD                                    | 1,62 %   |  | 363.714,817                        | 7,70                         | -                    | -                    |
| AM30 EUR                                    | 1,63 %   |  | 850.073,709                        | 7,58                         | 7,85                 | 9,35                 |
| AM30 GBP                                    | 1,62 %   |  | 14.057,837                         | 13,17                        | -                    | -                    |
| AM30 RMB                                    | 1,63 %   |  | 9.015.283,870                      | 1,02                         | 1,11                 | 1,39                 |
| AM30 SGD                                    | 1,63 %   |  | 88.961,956                         | 5,36                         | 5,60                 | 6,39                 |
| EC  | 1,90 %   |  | 9.298,515                          | 9,87                         | 9,60                 | 10,52                |
| ECH EUR                                     | 1,93 %   |  | 4.862,693                          | 9,59                         | 9,57                 | 11,05                |
| XC  | 0,80 %   |  | 148.366,619                        | 8,62                         | 8,30                 | 8,99                 |
| <b>Gesamtnettovermögen</b>                  |  |  |                                    | <b>277.433.598</b>           | <b>420.838.099</b>   | <b>558.537.115</b>   |
| Multi-Asset Style Factors EUR               |  |  |                                    |                              |                      |                      |
| AC  | 1,60 %   |  | 2.489.722,288                      | 10,45                        | 9,90                 | 10,02                |
| AD  | 1,60 %   |  | 187.891,742                        | 10,62                        | 10,06                | 10,18                |
| BC  | 0,90 %   |  | 125.142,879                        | 11,21                        | 10,55                | 10,60                |
| BCH GBP                                     | 0,92 %   |  | 15.302,447                         | 12,68                        | 11,46                | 11,78                |
| EC  | 2,10 %   |  | 152.009,734                        | 10,27                        | 9,78                 | 9,95                 |
| IC  | 0,90 %   |  | 1.285.674,234                      | 11,28                        | 10,61                | 10,67                |
| ICH CHF**                                   | -  |  | -                                  | -                            | 9,40                 | 9,23                 |
| ID  | 0,90 %   |  | 96.000,000                         | 10,50                        | 9,89                 | 9,93                 |
| XC  | 0,67 %   |  | 17.432.491,379                     | 11,38                        | 10,69                | 10,71                |
| XCH JPY                                     | 0,68 %   |  | 564.786,667                        | 61,73                        | 68,12                | 73,62                |
| ZC  | 0,11 %   |  | 29.170.969,447                     | 11,86                        | 11,07                | 11,04                |
| ZCH CHF                                     | 0,16 %   |  | 156.503,000                        | 10,34                        | 9,68                 | 9,43                 |
| ZCH GBP                                     | 0,15 %   |  | 11.785.103,962                     | 14,46                        | 12,97                | 13,22                |
| ZCH USD                                     | 0,15 %   |  | 2.286.366,143                      | 10,58                        | 9,65                 | 9,17                 |
| <b>Gesamtnettovermögen</b>                  |  |  |                                    | <b>822.139.985</b>           | <b>1.166.556.888</b> | <b>1.189.335.426</b> |
| Multi-Strategy Target Return*** EUR         |  |  |                                    |                              |                      |                      |
| AC  | 1,75 %   |  | 102.541,685                        | 10,36                        | 9,75                 | 10,49                |
| BC**  | -  |  | -                                  | -                            | 10,01                | 10,69                |
| BCH GBP**                                   | -  |  | -                                  | -                            | 11,37                | -                    |
| IC  | 0,75 %   |  | 1.283.944,443                      | 11,36                        | 10,56                | 11,27                |
| ICH GBP                                     | 0,77 %   |  | 401,020                            | 14,17                        | 12,66                | 13,84                |
| ID  | 0,76 %   |  | 469,445                            | 11,17                        | 10,53                | 11,24                |
| XC  | 0,86 %   |  | 462,535                            | 11,37                        | 10,60                | 11,31                |
| XCH GBP                                     | 0,86 %   |  | 401,020                            | 14,21                        | 12,72                | 13,89                |
| ZC**  | -  |  | -                                  | -                            | -                    | 11,69                |
| ZCH GBP                                     | 0,22 %   |  | 7.523.977,527                      | 12,54                        | 11,15                | 12,11                |
| <b>Gesamtnettovermögen</b>                  |  |  |                                    | <b>109.999.724</b>           | <b>108.915.477</b>   | <b>108.801.928</b>   |
| US Income Focused USD                       |  |  |                                    |                              |                      |                      |
| AM2   | 1,54 %   |  | 28.739.124,345                     | 9,75                         | 9,03                 | 10,50                |
| AM2 HKD                                     | 1,54 %   |  | 113.011.702,469                    | 1,26                         | 1,16                 | 1,35                 |
| AM3H AUD                                    | 1,57 %   |  | 5.105.105,705                      | 6,16                         | 5,88                 | 7,74                 |
| AM3H CAD                                    | 1,57 %   |  | 1.728.484,852                      | 7,06                         | 6,56                 | 8,31                 |
| AM3H EUR                                    | 1,57 %   |  | 396.862,368                        | 10,35                        | 9,68                 | 11,61                |
| AM3H GBP                                    | 1,57 %   |  | 1.505.620,350                      | 12,03                        | 10,93                | 13,65                |
| AM3H JPY                                    | 1,54 %   |  | 14,940                             | 67,16                        | -                    | -                    |
| AM3H RMB                                    | 1,57 %   |  | 17.457.262,432                     | 1,33                         | 1,31                 | 1,65                 |
| <b>Gesamtnettovermögen</b>                  |  |  |                                    | <b>511.105.564</b>           | <b>408.772.242</b>   | <b>668.014.718</b>   |

\* Nettoinventarwert je Anteil mit Swing-Korrektur (siehe Erläuterung 14),

\*\* Die Anteilsklassen sind zum 31. März 2024 inaktiv,

\*\*\* Das Gesamtnettovermögen des Teilfonds und der Nettoinventarwert je Anteil der Anteilsklassen IC, ICH GBP und ID wurden für das Berichtsjahr angepasst, nach dem Ende des Jahres am 16. April 2024 eine überhöhte Abgrenzung der aufgelaufenen Verwaltungsgebühren von insgesamt 122,656 USD festgestellt wurde,

Der Nettoinventarwert je Anteil ist stets in der Währung des Teilfonds angegeben.

# Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens

für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024

|  | Erläuterungen | KONSOLIDIERT<br>USD   | Aktien-<br>teifonds      |                                |   |
|--|---------------|-----------------------|--------------------------|--------------------------------|---|
|  |               |                       | ASEAN<br>Equity *<br>USD | Asia ex<br>Japan Equity<br>USD | Asia ex<br>Japan<br>Equity<br>Smaller<br>Companies<br>USD |
| <b>Nettovermögen zu Beginn des<br/>Jahres/Berichtszeitraums</b>                |               | <b>30.657.560.942</b> | <b>36.051.444</b>        | <b>441.953.669</b>             | <b>488.947.322</b>  |
| <b>ERTRÄGE</b>   |               |                       |                          |                                |   |
| Anlageerträge, netto   |               | 1.746.700.892         | 958.406                  | 8.668.312                      | 11.968.717  |
| Bankzinsen   |               | 16.114.784            | 19.980                   | 315.329                        | 418.181   |
| Sonstige Erträge   | 10            | 39.521.610            | 10.516                   | 506.625                        | 3.554.350   |
| <b>Summe Erträge</b>   |               | <b>1.802.337.286</b>  | <b>988.902</b>           | <b>9.490.266</b>               | <b>15.941.248</b>   |
| <b>AUFWENDUNGEN</b>  |               |                       |                          |                                |   |
| Verwaltungsgebühren  | 4,b           | (133.862.153)         | (450.518)                | (3.015.272)                    | (3.470.409)   |
| Transaktionskosten   | 5             | (15.895.161)          | (41.612)                 | (1.300.279)                    | (2.866.805)   |
| Betriebskosten, Verwaltungs- und<br>Kontoführungsgebühren                      | 4,d           | (60.413.913)          | (103.171)                | (1.018.721)                    | (1.143.250)   |
| Sonstige Gebühren  |               | (65.577)              | -                        | -                              | -   |
| <b>Summe Aufwendungen</b>  |               | <b>(210.236.804)</b>  | <b>(595.301)</b>         | <b>(5.334.272)</b>             | <b>(7.480.464)</b>  |
| <b>Nettoanlagegewinn/(-verlust)</b>  |               | <b>1.592.100.482</b>  | <b>393.601</b>           | <b>4.155.994</b>               | <b>8.460.784</b>  |
| Realisierter Gewinn/(Verlust) aus:   |               |                       |                          |                                |   |
| - Anlagen  | 2,e           | (951.571.192)         | (2.300.465)              | (53.257.111)                   | 37.935.112  |
| - Derivaten  |               | (15.821.716)          | -                        | 112                            | -   |
| - Devisengeschäften  |               | (470.066.247)         | (155.940)                | (216.151)                      | (855.427)   |
| <b>Realisierter Gewinn/(Verlust) des<br/>Geschäftsjahres/Berichtszeitraums</b> |               | <b>154.641.327</b>    | <b>(2.062.804)</b>       | <b>(49.317.156)</b>            | <b>45.540.469</b>   |
| Veränderung des nicht realisierten<br>Bewertungsergebnisses aus:               |               |                       |                          |                                |   |
| - Anlagen  |               | 2.081.201.583         | 105.626                  | 54.720.641                     | 27.318.687  |
| - Derivaten  |               | (25.011.755)          | -                        | (220.666)                      | -   |
| <b>Veränderung des Nettovermögens<br/>aufgrund der Geschäftstätigkeit</b>      |               | <b>2.210.831.155</b>  | <b>(1.957.178)</b>       | <b>5.182.819</b>               | <b>72.859.156</b>   |
| Erlöse aus der Ausgabe von Anteilen  |               | 19.426.060.070        | 2.242.388                | 46.542.778                     | 77.941.273  |
| Zahlungen bei der Rücknahme von Anteilen                                       |               | (18.051.674.111)      | (8.346.431)              | (182.995.750)                  | (246.564.659)   |
| Dividendenzahlungen  | 9             | (963.127.282)         | (493.264)                | (3.222.824)                    | (551.223)   |
| Währungsumrechnung   | 2,f           | (26.134.743)          | -                        | -                              | -   |
| <b>Nettovermögen zum Ende des<br/>Jahres/Berichtszeitraums</b>                 |               | <b>33.253.516.031</b> | <b>27.496.959</b>        | <b>307.460.692</b>             | <b>392.631.869</b>  |

\* Bis zum 31. Juli 2023 lautete der Name des Teilfonds „Thai Equity“.

# Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens

für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024

| Asia Pacific ex<br>Japan Equity<br>High Dividend<br>USD | China A-Shares<br>Equity<br>USD | Chinese Equity<br>USD | Euroland<br>Equity Smaller<br>Companies<br>EUR | Euroland<br>Growth<br>EUR | Euroland Value<br>EUR | Europe Value<br>EUR |
|---|---------------------------------|-----------------------|--|---------------------------|-----------------------|---------------------|
| <b>413.697.275</b>                                      | <b>20.952.438</b>               | <b>761.626.018</b>    | <b>109.218.855</b>                             | <b>287.493.353</b>        | <b>298.987.918</b>    | <b>78.922.996</b>   |
| 15.076.340  | 474.112                         | 16.919.109            | 2.820.495                                      | 4.738.861                 | 9.850.344             | 2.483.955           |
| 334.565   | 9.837                           | 53.126                | 36.060   | 75.397                    | 48.989                | 6.424               |
| 301.048   | 72.293                          | 316.937               | 19.796   | 127.809                   | 226.784               | 26.652              |
| <b>15.711.953</b>                                       | <b>556.242</b>                  | <b>17.289.172</b>     | <b>2.876.351</b>                               | <b>4.942.067</b>          | <b>10.126.117</b>     | <b>2.517.031</b>    |
| (3.186.495)   | (6.496)                         | (8.833.607)           | (782.328)                                      | (2.481.295)               | (2.220.980)           | (670.577)           |
| (781.823)   | (115.464)                       | (1.907.533)           | (33.952)                                       | (87.140)                  | (156.510)             | (42.321)            |
| (907.621)   | (71.500)                        | (2.450.367)           | (268.735)                                      | (689.759)                 | (590.904)             | (224.590)           |
| (139)   | -                               | -                     | (102)  | (32)                      | (244)                 | (24)                |
| <b>(4.876.078)</b>                                      | <b>(193.460)</b>                | <b>(13.191.507)</b>   | <b>(1.085.117)</b>                             | <b>(3.258.226)</b>        | <b>(2.968.638)</b>    | <b>(937.512)</b>    |
| <b>10.835.875</b>                                       | <b>362.782</b>                  | <b>4.097.665</b>      | <b>1.791.234</b>                               | <b>1.683.841</b>          | <b>7.157.479</b>      | <b>1.579.519</b>    |
| (12.743.122)  | (2.544.334)                     | (125.533.575)         | (1.574.728)                                    | 19.363.181                | 14.486.698            | 6.703.210           |
| (880.307)   | 49.776                          | -                     | 94   | 1.265.830                 | 736.640               | -                   |
| (172.525)   | 25.800                          | (143.756)             | 1.399  | 5.712                     | 28.211                | 34.721              |
| <b>(2.960.079)</b>                                      | <b>(2.105.976)</b>              | <b>(121.579.666)</b>  | <b>217.999</b>                                 | <b>22.318.564</b>         | <b>22.409.028</b>     | <b>8.317.450</b>    |
| 20.674.851  | 186.423                         | 14.749.598            | 6.539.543                                      | (7.188.453)               | 16.449.963            | (35.233)            |
| (45.893)  | (1.284)                         | -                     | 803  | (313.375)                 | (34.928)              | -                   |
| <b>17.668.879</b>                                       | <b>(1.920.837)</b>              | <b>(106.830.068)</b>  | <b>6.758.345</b>                               | <b>14.816.736</b>         | <b>38.824.063</b>     | <b>8.282.217</b>    |
| 92.795.795  | 14.401.030                      | 112.815.438           | 7.220.905                                      | 24.158.023                | 92.757.790            | 9.458.072           |
| (243.722.200)   | (9.716.960)                     | (179.962.921)         | (19.432.318)                                   | (126.570.385)             | (178.204.659)         | (33.632.987)        |
| (10.456.525)  | (670)                           | (6.233.718)           | (39.743)                                       | (4.182)                   | (438.107)             | (1.323.588)         |
| -   | -                               | -                     | -  | -                         | -                     | -                   |
| <b>269.983.224</b>                                      | <b>23.715.001</b>               | <b>581.414.749</b>    | <b>103.726.044</b>                             | <b>199.893.545</b>        | <b>251.927.005</b>    | <b>61.706.710</b>   |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens

für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024

|  | Erläuterungen | Global Emerging Markets Equity USD | Global Equity Circular Economy USD | Global Equity Climate Change USD | Global Equity Sustainable Healthcare USD |
|--|---------------|------------------------------------|------------------------------------|----------------------------------|--|
| <b>Nettovermögen zu Beginn des Jahres/Berichtszeitraums</b>                |               | <b>401.621.285</b>                 | <b>29.600.886</b>                  | <b>297.237.965</b>               | <b>136.633.554</b>                       |
| <b>ERTRÄGE</b>   |               |                                    |                                    |                                  |  |
| Anlageerträge, netto   |               | 9.841.201                          | 795.471                            | 3.123.000                        | 671.161                                  |
| Bankzinsen   |               | 387.815                            | 19.341                             | 202.398                          | 172.594                                  |
| Sonstige Erträge   | 10            | 293.529                            | 70.676                             | 140.945                          | 106.701                                  |
| <b>Summe Erträge</b>   |               | <b>10.522.545</b>                  | <b>885.488</b>                     | <b>3.466.343</b>                 | <b>950.456</b>                           |
| <b>AUFWENDUNGEN</b>  |               |                                    |                                    |                                  |  |
| Verwaltungsgebühren  | 4,b           | (4.547.234)                        | (37.600)                           | (2.110.510)                      | (1.297.106)                              |
| Transaktionskosten   | 5             | (911.744)                          | (80.297)                           | (131.221)                        | (85.711)                                 |
| Betriebskosten, Verwaltungs- und Kontoführungsgebühren                     | 4,d           | (1.340.537)                        | (124.962)                          | (677.908)                        | (399.438)                                |
| Sonstige Gebühren  |               | -                                  | -                                  | -                                | -  |
| <b>Summe Aufwendungen</b>  |               | <b>(6.799.515)</b>                 | <b>(242.859)</b>                   | <b>(2.919.639)</b>               | <b>(1.782.255)</b>                       |
| <b>Nettoanlagegewinn/(-verlust)</b>  |               | <b>3.723.030</b>                   | <b>642.629</b>                     | <b>546.704</b>                   | <b>(831.799)</b>                         |
| Realisierter Gewinn/(Verlust) aus:   |               |                                    |                                    |                                  |  |
| - Anlagen  | 2,e           | (14.137.601)                       | 321.005                            | (4.363.725)                      | (2.829.693)                              |
| - Derivaten  |               | -                                  | 423.949                            | 2.305                            | (24.198)                                 |
| - Devisengeschäften  |               | (584.799)                          | (503.259)                          | (93.693)                         | (36.868)                                 |
| <b>Realisierter Gewinn/(Verlust) des Geschäftsjahres/Berichtszeitraums</b> |               | <b>(10.999.370)</b>                | <b>884.324</b>                     | <b>(3.908.409)</b>               | <b>(3.722.558)</b>                       |
| Veränderung des nicht realisierten Bewertungsergebnisses aus:              |               |                                    |                                    |                                  |  |
| - Anlagen  |               | 33.815.802                         | 12.076.718                         | 27.859.055                       | 49.024.642                               |
| - Derivaten  |               | -                                  | -                                  | (13.032)                         | (94.477)                                 |
| <b>Veränderung des Nettovermögens aufgrund der Geschäftstätigkeit</b>      |               | <b>22.816.432</b>                  | <b>12.961.042</b>                  | <b>23.937.614</b>                | <b>45.207.607</b>                        |
| Erlöse aus der Ausgabe von Anteilen  |               | 50.073.345                         | 70.671.615                         | 60.129.383                       | 153.773.581                              |
| Zahlungen bei der Rücknahme von Anteilen                                   |               | (106.152.985)                      | (367.936)                          | (69.148.869)                     | (33.366.600)                             |
| Dividendenzahlungen  | 9             | (219.986)                          | -                                  | (1.411.842)                      | -  |
| Währungsumrechnung   | 2,f           | -                                  | -                                  | -                                | -  |
| <b>Nettovermögen zum Ende des Jahres/Berichtszeitraums</b>                 |               | <b>368.138.091</b>                 | <b>112.865.607</b>                 | <b>310.744.251</b>               | <b>302.248.142</b>                       |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens

für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024

| Global Infrastructure Equity USD | Global Lower Carbon Equity USD | Global Real Estate Equity USD | Global Sustainable Equity Income USD | Global Sustainable Long Term Dividend USD | Global Sustainable Long Term Equity USD | Hong Kong Equity USD |
|----------------------------------|--------------------------------|-------------------------------|--------------------------------------|---|---|----------------------|
| <b>651.906.409</b>               | <b>270.407.334</b>             | <b>690.088.043</b>            | <b>150.650.459</b>                   | <b>23.651.672</b>                         | <b>11.496.568</b>                       | <b>137.904.206</b>   |
| 24.329.849                       | 6.500.856                      | 20.550.308                    | 4.470.468                            | 591.216                                   | 407.249                                 | 4.573.619            |
| 96.938                           | 130.270                        | 328.910                       | 67.726                               | 16.148                                    | 21.234                                  | 8.405                |
| 1.264.116                        | 133.649                        | 2.541.267                     | 224.204                              | 151.959                                   | 94.546                                  | 185.287              |
| <b>25.690.903</b>                | <b>6.764.775</b>               | <b>23.420.485</b>             | <b>4.762.398</b>                     | <b>759.323</b>                            | <b>523.029</b>                          | <b>4.767.311</b>     |
| (219.611)                        | (1.166.475)                    | (141.362)                     | (6)                                  | (419.099)                                 | (5.413)                                 | (1.362.144)          |
| (506.404)                        | (286.384)                      | (453.881)                     | (190.610)                            | (111.743)                                 | (60.333)                                | (440.814)            |
| (943.460)                        | (713.367)                      | (747.189)                     | (293.738)                            | (107.763)                                 | (92.782)                                | (412.102)            |
| (1.286)                          | -                              | (800)                         | -                                    | (123)                                     | (13)                                    | (1)                  |
| <b>(1.670.761)</b>               | <b>(2.166.226)</b>             | <b>(1.343.232)</b>            | <b>(484.354)</b>                     | <b>(638.728)</b>                          | <b>(158.541)</b>                        | <b>(2.215.061)</b>   |
| <b>24.020.142</b>                | <b>4.598.549</b>               | <b>22.077.253</b>             | <b>4.278.044</b>                     | <b>120.595</b>                            | <b>364.488</b>                          | <b>2.552.250</b>     |
| 22.202.911                       | 2.615.385                      | (72.705.572)                  | 1.256.451                            | 969.589                                   | 1.717.874                               | (22.216.365)         |
| (584.776)                        | 1.182.766                      | (4.558)                       | 428.016                              | -   | -                                       | -                    |
| (530.054)                        | (168.827)                      | (205.521)                     | 15.407                               | (10.914)                                  | (144)                                   | 7.424                |
| <b>45.108.223</b>                | <b>8.227.873</b>               | <b>(50.838.398)</b>           | <b>5.977.918</b>                     | <b>1.079.270</b>                          | <b>2.082.218</b>                        | <b>(19.656.691)</b>  |
| 29.278.623                       | 64.371.165                     | 93.206.206                    | 33.020.509                           | 4.605.940                                 | 12.129.592                              | (4.780.663)          |
| (177.930)                        | (194.291)                      | (1.438)                       | (49.980)                             | -   | -                                       | -                    |
| <b>74.208.916</b>                | <b>72.404.747</b>              | <b>42.366.370</b>             | <b>38.948.447</b>                    | <b>5.685.210</b>                          | <b>14.211.810</b>                       | <b>(24.437.354)</b>  |
| 386.854.062                      | 122.945.682                    | 297.349.992                   | 126.971.090                          | 85.654.140                                | 90.733.487                              | 70.821.243           |
| (212.077.431)                    | (89.734.407)                   | (367.380.036)                 | (65.545.993)                         | (66.236.457)                              | (7.564.209)                             | (57.469.690)         |
| (17.611.546)                     | (3.321.736)                    | (18.828.586)                  | (4.550.572)                          | (557.711)                                 | (243.819)                               | (1.421.591)          |
| -                                | -                              | -                             | -                                    | -   | -                                       | -                    |
| <b>883.280.410</b>               | <b>372.701.620</b>             | <b>643.595.783</b>            | <b>246.473.431</b>                   | <b>48.196.854</b>                         | <b>108.633.837</b>                      | <b>125.396.814</b>   |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



# Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens

für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024

|  | Erläuterungen | Internationale und regionale Aktiefondsfonds |                                 |                            |   |
|--|---------------|--|---------------------------------|----------------------------|---|
|  |               | BRIC Equity**<br>USD                         | BRIC Markets<br>Equity**<br>USD | Frontier<br>Markets<br>USD | Global Equity<br>Volatility<br>Focused**<br>USD |
| <b>Nettovermögen zu Beginn des Jahres/Berichtszeitraums</b>                |               | <b>112.091.346</b>                           | <b>42.001.466</b>               | <b>235.789.493</b>         | <b>118.997.825</b>                              |
| <b>ERTRÄGE</b>   |               |  |                                 |                            |   |
| Anlageerträge, netto   |               | 3.614.909                                    | 1.363.456                       | 13.799.809                 | 2.778.245                                       |
| Bankzinsen   |               | 59.235                                       | 30.613                          | 4.229                      | 64.781  |
| Sonstige Erträge   | 10            | -  | 3.154                           | 1.208.007                  | 83.726  |
| <b>Summe Erträge</b>   |               | <b>3.674.144</b>                             | <b>1.397.223</b>                | <b>15.012.045</b>          | <b>2.926.752</b>                                |
| <b>AUFWENDUNGEN</b>  |               |  |                                 |                            |   |
| Verwaltungsgebühren  | 4,b           | (1.143.953)                                  | (597.612)                       | (3.835.827)                | (982.389)                                       |
| Transaktionskosten   | 5             | (90.984)                                     | (34.115)                        | (1.005.142)                | (142.805)                                       |
| Betriebskosten, Verwaltungs- und Kontoführungsgebühren                     | 4,d           | (367.522)                                    | (139.485)                       | (1.213.017)                | (436.004)                                       |
| Sonstige Gebühren  |               | -  | -                               | (3.782)                    | (24)  |
| <b>Summe Aufwendungen</b>  |               | <b>(1.602.459)</b>                           | <b>(771.212)</b>                | <b>(6.057.768)</b>         | <b>(1.561.222)</b>                              |
| <b>Nettoanlagegewinn/(-verlust)</b>  |               | <b>2.071.685</b>                             | <b>626.011</b>                  | <b>8.954.277</b>           | <b>1.365.530</b>                                |
| Realisierter Gewinn/(Verlust) aus:   |               |  |                                 |                            |   |
| - Anlagen  | 2,e           | (2.094.765)                                  | (939.810)                       | 37.845.623                 | 3.404.394                                       |
| - Derivaten  |               | -  | -                               | -                          | (219.544)                                       |
| - Devisengeschäften  |               | (14.538)                                     | (5.074)                         | (288.255)                  | (113.366)                                       |
| <b>Realisierter Gewinn/(Verlust) des Geschäftsjahres/Berichtszeitraums</b> |               | <b>(37.618)</b>                              | <b>(318.873)</b>                | <b>46.511.645</b>          | <b>4.437.014</b>                                |
| Veränderung des nicht realisierten Bewertungsergebnisses aus:              |               |  |                                 |                            |   |
| - Anlagen  |               | 6.365.344                                    | 2.624.246                       | 58.071.082                 | 15.684.719                                      |
| - Derivaten  |               | -  | -                               | -                          | (397.142)                                       |
| <b>Veränderung des Nettovermögens aufgrund der Geschäftstätigkeit</b>      |               | <b>6.327.726</b>                             | <b>2.305.373</b>                | <b>104.582.727</b>         | <b>19.724.591</b>                               |
| Erlöse aus der Ausgabe von Anteilen  |               | 913.893                                      | 2.330.981                       | 179.698.277                | 58.006.022                                      |
| Zahlungen bei der Rücknahme von Anteilen                                   |               | (17.267.113)                                 | (6.232.570)                     | (64.217.593)               | (66.180.589)                                    |
| Dividendenzahlungen  | 9             | (613.441)                                    | (213.339)                       | (3.617.562)                | (1.416.555)                                     |
| Währungsumrechnung   | 2,f           | -  | -                               | -                          | -   |
| <b>Nettovermögen zum Ende des Jahres/Berichtszeitraums</b>                 |               | <b>101.452.411</b>                           | <b>40.191.911</b>               | <b>452.235.342</b>         | <b>129.131.294</b>                              |

\*\* Aufgrund der Marktgegebenheiten infolge der Ukraine- und Russland-Krise seit dem 25. Februar 2022 haben der Ausschuss für die Preisbestimmung und die Verwaltungsgesellschaft vereinbart und veranlasst, dass alle auf Rubel lautenden russischen Aktien im Anlageportfolio auf null abgeschrieben werden,

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens

für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024

| Marktspezifische Aktiefonds |                              |                      |   |                    |                    | Rententeilfonds    |
|-----------------------------|------------------------------|----------------------|---|--------------------|--------------------|--------------------|
| Brazil Equity USD           | Economic Scale US Equity USD | Indian Equity USD    | Mexico Equity (geschlossen zum 28. Juli 2023) USD | Russia Equity* USD | Turkey Equity EUR  | Asia Bond USD      |
| 139.910.375                 | 260.843.203                  | 953.319.973          | 16.115.320  | 10.312.334         | 99.347.576         | 491.814.430        |
| 7.854.208                   | 4.079.461                    | 9.886.299            | 286.540   | -                  | 1.507.738          | 20.082.920         |
| 123.255                     | 138.756                      | 732.325              | 3.151   | 549.994            | 468.071            | 145.406            |
| 62.919                      | 91.187                       | 628.839              | 49.901  | -                  | 1.050.833          | 624.762            |
| <b>8.040.382</b>            | <b>4.309.404</b>             | <b>11.247.463</b>    | <b>339.592</b>                                    | <b>549.994</b>     | <b>3.026.642</b>   | <b>20.853.088</b>  |
| (2.147.155)                 | (1.220.107)                  | (15.101.530)         | (103.067)   | -                  | (1.415.577)        | (539.086)          |
| (109.095)                   | (15.323)                     | (1.552.166)          | -   | -                  | (247.887)          | (27)               |
| (574.223)                   | (856.622)                    | (4.282.989)          | (23.829)  | -                  | (344.921)          | (795.626)          |
| (861)                       | -                            | -                    | -   | -                  | -                  | (172)              |
| <b>(2.831.334)</b>          | <b>(2.092.052)</b>           | <b>(20.936.685)</b>  | <b>(126.896)</b>                                  | <b>-</b>           | <b>(2.008.385)</b> | <b>(1.334.911)</b> |
| <b>5.209.048</b>            | <b>2.217.352</b>             | <b>(9.689.222)</b>   | <b>212.696</b>                                    | <b>549.994</b>     | <b>1.018.257</b>   | <b>19.518.177</b>  |
| (2.147.788)                 | 14.428.630                   | 43.168.757           | 3.220.639   | (5.404,501)**      | 13.993.439         | (18.400.463)       |
| -                           | 122.756                      | -                    | -   | -                  | -                  | 3.467.744          |
| (205.014)                   | 460                          | 176.111              | 182.187   | 9.158              | (1.320.656)        | (198.866)          |
| <b>2.856.246</b>            | <b>16.769.198</b>            | <b>33.655.646</b>    | <b>3.615.522</b>                                  | <b>(4.845.349)</b> | <b>13.691.040</b>  | <b>4.386.592</b>   |
| 27.135.215                  | 36.090.220                   | 296.311.701          | (2.448.077)                                       | 6.320.344          | (1.835.000)        | 15.459.717         |
| -                           | (985.335)                    | -                    | -   | -                  | -                  | (6.857.706)        |
| <b>29.991.461</b>           | <b>51.874.083</b>            | <b>329.967.347</b>   | <b>1.167.445</b>                                  | <b>1.474.995</b>   | <b>11.856.040</b>  | <b>12.988.603</b>  |
| 28.094.927                  | 75.783.228                   | 375.253.629          | 9.414.685   | -                  | 156.900.378        | 106.513.611        |
| (45.394.677)                | (122.033.645)                | (245.259.373)        | (26.697.450)                                      | -                  | (172.792.237)      | (232.863.434)      |
| (4.397.950)                 | (809.549)                    | (198.561)            | -   | -                  | (95.933)           | (19.744.334)       |
| -                           | -                            | -                    | -   | -                  | -                  | -                  |
| <b>148.204.136</b>          | <b>265.657.320</b>           | <b>1.413.083.015</b> | <b>-</b>  | <b>11.787.329</b>  | <b>95.215.824</b>  | <b>358.708.876</b> |

\* Der Handel und die Berechnung des offiziellen Nettoinventarwerts des Teilfonds Russia Equity sind seit 25. Februar 2022 aufgrund der Schließung der Moskauer Börse ausgesetzt, Ein indikativer Nettoinventarwert zum 31. März 2024 wurde lediglich zu Darstellungszwecken im Jahresabschluss errechnet, Der Ausschuss für die Preisbestimmung und die Verwaltungsgesellschaft haben vereinbart und veranlasst, dass alle auf Rubel lautenden russischen Aktien im Anlageportfolio auf null abgeschrieben werden.\* Die bis zum 31. März 2024 aufgelaufenen Verwaltungsgebühren und Betriebskosten, Verwaltungs- und Kontoführungsgebühren wurden im laufenden Geschäftsjahr aufgelöst, da der Russia Equity seit dem 25. Februar 2022 ausgesetzt ist,

\*\* Einzelheiten zum realisierten Verlust aus Wertpapieranlagen sind in Erläuterung 2.b dargelegt

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens

für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024

|  | Erläuterungen | Asia ESG<br>Bond<br>USD | Asia High<br>Yield Bond<br>USD | Asian<br>Currencies<br>Bond<br>USD | Brazil Bond<br>USD |
|--|---------------|-------------------------|--------------------------------|------------------------------------|--------------------|
| <b>Nettovermögen zu Beginn des Jahres/Berichtszeitraums</b>                |               | <b>45.388.691</b>       | <b>1.142.030.519</b>           | <b>35.053.330</b>                  | <b>31.846.377</b>  |
| <b>ERTRÄGE</b>   |               |                         |                                |                                    |                    |
| Anlageerträge, netto   |               | 2.042.706               | 86.949.220                     | 3.263.295                          | 3.450.739          |
| Bankzinsen   |               | 12.647                  | 632.916                        | 11.719                             | 9.150              |
| Sonstige Erträge   | 10            | 80.629                  | 2.605.181                      | 23.106                             | 1.591              |
| <b>Summe Erträge</b>   |               | <b>2.135.982</b>        | <b>90.187.317</b>              | <b>3.298.120</b>                   | <b>3.461.480</b>   |
| <b>AUFWENDUNGEN</b>  |               |                         |                                |                                    |                    |
| Verwaltungsgebühren  | 4,b           | (3.772)                 | (5.975.747)                    | (38.170)                           | (345.762)          |
| Transaktionskosten   | 5             | -                       | (32)                           | (16.726)                           | -                  |
| Betriebskosten, Verwaltungs- und Kontoführungsgebühren                     | 4,d           | (92.312)                | (1.983.177)                    | (73.496)                           | (124.766)          |
| Sonstige Gebühren  |               | (30)                    | (27.784)                       | (9)                                | -                  |
| <b>Summe Aufwendungen</b>  |               | <b>(96.114)</b>         | <b>(7.986.740)</b>             | <b>(128.401)</b>                   | <b>(470.528)</b>   |
| <b>Nettoanlagegewinn/(-verlust)</b>  |               | <b>2.039.868</b>        | <b>82.200.577</b>              | <b>3.169.719</b>                   | <b>2.990.952</b>   |
| Realisierter Gewinn/(Verlust) aus:   |               |                         |                                |                                    |                    |
| - Anlagen  | 2,e           | (3.256.650)             | (218.715.628)                  | (1.609.544)                        | 2.285.724          |
| - Derivaten  |               | (989)                   | (4.692.994)                    | (97.938)                           | (182.291)          |
| - Devisengeschäften  |               | 1                       | (190.161)                      | (1.314.299)                        | (106.187)          |
| <b>Realisierter Gewinn/(Verlust) des Geschäftsjahres/Berichtszeitraums</b> |               | <b>(1.217.770)</b>      | <b>(141.398.206)</b>           | <b>147.938</b>                     | <b>4.988.198</b>   |
| Veränderung des nicht realisierten Bewertungsergebnisses aus:              |               |                         |                                |                                    |                    |
| - Anlagen  |               | 1.501.928               | 85.849.923                     | (692.157)                          | (344.835)          |
| - Derivaten  |               | (1.726)                 | (2.227.834)                    | (1.262)                            | 91.019             |
| <b>Veränderung des Nettovermögens aufgrund der Geschäftstätigkeit</b>      |               | <b>282.432</b>          | <b>(57.776.117)</b>            | <b>(545.481)</b>                   | <b>4.734.382</b>   |
| Erlöse aus der Ausgabe von Anteilen  |               | 543.008                 | 121.308.440                    | 2.927.618                          | 13.892.264         |
| Zahlungen bei der Rücknahme von Anteilen                                   |               | (20.131.046)            | (480.889.859)                  | (12.352.181)                       | (12.045.706)       |
| Dividendenzahlungen  | 9             | (22.444)                | (57.537.739)                   | (1.667.847)                        | (125.823)          |
| Währungsumrechnung   | 2,f           | -                       | -                              | -                                  | -                  |
| <b>Nettovermögen zum Ende des Jahres/Berichtszeitraums</b>                 |               | <b>26.060.641</b>       | <b>667.135.244</b>             | <b>23.415.439</b>                  | <b>38.301.494</b>  |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens

für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024

| Corporate Euro Bond Fixed Term 2027 (aufgelegt zum 30. Juni 2023) EUR | Euro Bond EUR      | Euro Bond Total Return EUR | Euro Credit Bond EUR | Euro High Yield Bond EUR | ESG Short Duration Credit Bond USD | GEM Debt Total Return USD |
|---|--------------------|----------------------------|----------------------|--------------------------|------------------------------------|---------------------------|
| -   | 57.075.368         | 124.766.811                | 345.254.148          | 1.041.658.661            | 5.504.133                          | 125.663.112               |
| 3.879.446   | 843.105            | 3.304.731                  | 12.388.509           | 35.520.466               | 389.450                            | 7.041.518                 |
| 6.402   | 10.293             | 63.993                     | 61.764               | 229.710                  | 2.638                              | 89.462                    |
| 289.878   | 12.285             | 172.036                    | 288.765              | 3.715.897                | 8.455                              | 230.766                   |
| <b>4.175.726</b>  | <b>865.683</b>     | <b>3.540.760</b>           | <b>12.739.038</b>    | <b>39.466.073</b>        | <b>400.543</b>                     | <b>7.361.746</b>          |
| (448.333)   | (146.836)          | (58.180)                   | (1.089.915)          | (4.312.012)              | (21.048)                           | (580.451)                 |
| -   | -                  | -                          | -                    | -                        | -                                  | (120.385)                 |
| (147.560)   | (90.602)           | (167.752)                  | (615.431)            | (1.539.753)              | (14.812)                           | (290.927)                 |
| (310)   | (30)               | (1.234)                    | (1.341)              | (95)                     | -                                  | (2.011)                   |
| <b>(596.203)</b>  | <b>(237.468)</b>   | <b>(227.166)</b>           | <b>(1.706.687)</b>   | <b>(5.851.860)</b>       | <b>(35.860)</b>                    | <b>(993.774)</b>          |
| <b>3.579.523</b>  | <b>628.215</b>     | <b>3.313.594</b>           | <b>11.032.351</b>    | <b>33.614.213</b>        | <b>364.683</b>                     | <b>6.367.972</b>          |
| 62.215  | (1.599.208)        | 554.198                    | (1.764.441)          | (76.952.887)             | (69.646)                           | 591.820                   |
| 26.635  | (44.923)           | (1.583.782)                | (2.075.969)          | (14.254)                 | 24.886                             | (1.689.739)               |
| (2.260)   | 247                | (42.197)                   | (1.356)              | (786)                    | (43.338)                           | (382.930)                 |
| <b>3.666.113</b>  | <b>(1.015.669)</b> | <b>2.241.813</b>           | <b>7.190.585</b>     | <b>(43.353.714)</b>      | <b>276.585</b>                     | <b>4.887.123</b>          |
| 3.578.119   | 3.542.779          | 3.930.979                  | 17.116.192           | 125.538.058              | 148.738                            | 1.343.345                 |
| 36.543  | 233                | (137.515)                  | 59.976               | 155.512                  | (30.681)                           | (1.701.409)               |
| <b>7.280.775</b>  | <b>2.527.343</b>   | <b>6.035.277</b>           | <b>24.366.753</b>    | <b>82.339.856</b>        | <b>394.642</b>                     | <b>4.529.059</b>          |
| 181.046.735   | 6.309.916          | 17.203.538                 | 133.109.788          | 405.238.591              | 3.543.479                          | 1.347.233                 |
| (6.828.731)   | (10.519.917)       | (54.852.060)               | (76.628.923)         | (762.244.732)            | (1.646.737)                        | (92.456.295)              |
| -   | (4.118)            | (57.714)                   | (1.061.154)          | (12.929.148)             | (375.403)                          | (2.312.064)               |
| -   | -                  | -                          | -                    | -                        | -                                  | -                         |
| <b>181.498.779</b>  | <b>55.388.592</b>  | <b>93.095.852</b>          | <b>425.040.612</b>   | <b>754.063.228</b>       | <b>7.420.114</b>                   | <b>36.771.045</b>         |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens

für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024

|  | Erläuterungen | Global Bond<br>USD | Global Bond<br>Total Return<br>USD | Global<br>Corporate<br>Bond<br>USD | Global<br>Emerging<br>Markets Bond<br>USD |
|--|---------------|--------------------|------------------------------------|------------------------------------|---|
| <b>Nettovermögen zu Beginn des Jahres/Berichtszeitraums</b>                |               | <b>37.000.893</b>  | <b>191.309.646</b>                 | <b>2.564.709.922</b>               | <b>1.172.999.393</b>                      |
| <b>ERTRÄGE</b>   |               |                    |                                    |                                    |   |
| Anlageerträge, netto   |               | 1.245.932          | 9.684.221                          | 113.927.377                        | 79.526.833                                |
| Bankzinsen   |               | 18.328             | 158.273                            | 1.228.073                          | 158.664                                   |
| Sonstige Erträge   | 10            | 21.279             | 129.677                            | 2.978.972                          | 632.646                                   |
| <b>Summe Erträge</b>   |               | <b>1.285.539</b>   | <b>9.972.171</b>                   | <b>118.134.422</b>                 | <b>80.318.143</b>                         |
| <b>AUFWENDUNGEN</b>  |               |                    |                                    |                                    |   |
| Verwaltungsgebühren  | 4,b           | (90.435)           | (31.398)                           | (3.723)                            | (1.863.892)                               |
| Transaktionskosten   | 5             | -                  | (103)                              | -                                  | -   |
| Betriebskosten, Verwaltungs- und Kontoführungsgebühren                     | 4,d           | (53.785)           | (272.499)                          | (3.440.070)                        | (1.824.941)                               |
| Sonstige Gebühren  |               | (3)                | (328)                              | (3.444)                            | (2.054)                                   |
| <b>Summe Aufwendungen</b>  |               | <b>(144.223)</b>   | <b>(304.328)</b>                   | <b>(3.447.237)</b>                 | <b>(3.690.887)</b>                        |
| <b>Nettoanlagegewinn/(-verlust)</b>  |               | <b>1.141.316</b>   | <b>9.667.843</b>                   | <b>114.687.185</b>                 | <b>76.627.256</b>                         |
| Realisierter Gewinn/(Verlust) aus:   |               |                    |                                    |                                    |   |
| - Anlagen  | 2,e           | (1.553.073)        | (12.405.811)                       | (101.173.877)                      | (56.298.070)                              |
| - Derivaten  |               | (683.589)          | (16.708.410)                       | (23.775.720)                       | (6.081.214)                               |
| - Devisengeschäften  |               | (572.941)          | 1.549.565                          | 19.743.041                         | 132.931                                   |
| <b>Realisierter Gewinn/(Verlust) des Geschäftsjahres/Berichtszeitraums</b> |               | <b>(1.668.287)</b> | <b>(17.896.813)</b>                | <b>9.480.629</b>                   | <b>14.380.903</b>                         |
| Veränderung des nicht realisierten Bewertungsergebnisses aus:              |               |                    |                                    |                                    |   |
| - Anlagen  |               | 1.407.530          | 20.391.559                         | 166.814.090                        | 121.293.887                               |
| - Derivaten  |               | 32.234             | 9.705.988                          | 5.371.982                          | (9.821.524)                               |
| <b>Veränderung des Nettovermögens aufgrund der Geschäftstätigkeit</b>      |               | <b>(228.523)</b>   | <b>12.200.734</b>                  | <b>181.666.701</b>                 | <b>125.853.266</b>                        |
| Erlöse aus der Ausgabe von Anteilen  |               | 23.066.283         | 38.342.802                         | 1.718.730.261                      | 182.477.132                               |
| Zahlungen bei der Rücknahme von Anteilen                                   |               | (21.872.499)       | (19.212.463)                       | (1.032.270.677)                    | (394.446.241)                             |
| Dividendenzahlungen  | 9             | (471.780)          | (2.142.698)                        | (111.371.591)                      | (63.378.545)                              |
| Währungsumrechnung   | 2,f           | -                  | -                                  | -                                  | -   |
| <b>Nettovermögen zum Ende des Jahres/Berichtszeitraums</b>                 |               | <b>37.494.374</b>  | <b>220.498.021</b>                 | <b>3.321.464.616</b>               | <b>1.023.505.006</b>                      |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens

für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024

| Global Emerging Markets Corporate Sustainable Bond USD | Global Emerging Markets ESG Bond USD | Global Emerging Markets ESG Local Debt USD | Global Emerging Markets Local Debt USD | Global ESG Corporate Bond USD | Global Government Bond USD | Global Green Bond USD |
|--|--------------------------------------|--|--|-------------------------------|----------------------------|-----------------------|
| 112.217.456  | 100.352.835                          | 292.675.167                                | 1.274.054.242                          | 188.903.671                   | 2.962.519.709              | 26.633.159            |
| 8.324.618  | 5.625.917                            | 20.502.832                                 | 77.555.973                             | 5.713.498                     | 76.008.577                 | 1.850.769             |
| 132.708  | 22.634                               | 140.719                                    | 646.472                                | 142.759                       | 408.588                    | 140.102               |
| 107.061  | 210.058                              | 161.400                                    | 371.899                                | 70.701                        | 1.198.697                  | 193.396               |
| <b>8.564.387</b>                                       | <b>5.858.609</b>                     | <b>20.804.951</b>                          | <b>78.574.344</b>                      | <b>5.926.958</b>              | <b>77.615.862</b>          | <b>2.184.267</b>      |
| (587.362)  | (15)                                 | (283.716)                                  | (1.652.766)                            | (4)                           | (847)                      | (12.838)              |
| -  | -                                    | (147.872)                                  | (871.976)                              | -                             | (419)                      | -                     |
| (221.737)  | (181.013)                            | (562.117)                                  | (1.565.010)                            | (293.668)                     | (3.428.321)                | (129.623)             |
| (22)   | -                                    | (2.645)                                    | (2.053)                                | (832)                         | (1.067)                    | (982)                 |
| <b>(809.121)</b>                                       | <b>(181.028)</b>                     | <b>(996.350)</b>                           | <b>(4.091.805)</b>                     | <b>(294.504)</b>              | <b>(3.430.654)</b>         | <b>(143.443)</b>      |
| <b>7.755.266</b>                                       | <b>5.677.581</b>                     | <b>19.808.601</b>                          | <b>74.482.539</b>                      | <b>5.632.454</b>              | <b>74.185.208</b>          | <b>2.040.824</b>      |
| (687.483)  | (4.780.528)                          | 1.124.502                                  | (993.435)                              | (6.817.719)                   | (80.673.671)               | (2.137.842)           |
| (260.252)  | 354.002                              | (2.737.675)                                | (27.372.335)                           | (796.354)                     | 23.698.231                 | 1.867.382             |
| (14.181)   | 8.047                                | (2.944.136)                                | 4.228.051                              | 1.160.511                     | (55.728.184)               | (1.180.843)           |
| <b>6.793.350</b>                                       | <b>1.259.102</b>                     | <b>15.251.292</b>                          | <b>50.344.820</b>                      | <b>(821.108)</b>              | <b>(38.518.416)</b>        | <b>589.521</b>        |
| 4.453.293  | 7.763.886                            | 1.871.211                                  | (5.131.116)                            | 12.554.542                    | 82.099.978                 | 3.231.817             |
| 35.122   | (865.721)                            | (667.001)                                  | (4.817.938)                            | 519.968                       | 21.613.033                 | 199.716               |
| <b>11.281.765</b>                                      | <b>8.157.267</b>                     | <b>16.455.502</b>                          | <b>40.395.766</b>                      | <b>12.253.402</b>             | <b>65.194.595</b>          | <b>4.021.054</b>      |
| 30.569.697   | 22.759.905                           | 116.888.424                                | 94.456.609                             | 43.388.774                    | 2.813.378.245              | 63.599.077            |
| (11.020.770)   | (41.669.733)                         | (133.488.981)                              | (435.562.764)                          | (58.090.132)                  | (1.502.774.665)            | (30.267.922)          |
| (265.414)  | (4.207.909)                          | (11.426.849)                               | (55.207.764)                           | (5.833.228)                   | (75.789.368)               | (1.813.240)           |
| -  | -                                    | -  | -                                      | -                             | -                          | -                     |
| <b>142.782.734</b>                                     | <b>85.392.364</b>                    | <b>281.103.263</b>                         | <b>918.136.089</b>                     | <b>180.622.487</b>            | <b>4.262.528.516</b>       | <b>62.172.128</b>     |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens

für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024

|  | Erläuterungen | Global High<br>Income Bond<br>USD | Global High<br>Yield Bond<br>USD | Global High<br>Yield ESG<br>Bond<br>USD | Global High<br>Yield<br>Securitized<br>Credit Bond<br>USD |
|--|---------------|-----------------------------------|----------------------------------|---|---|
| <b>Nettovermögen zu Beginn des Jahres/Berichtszeitraums</b>                |               | <b>789.795.418</b>                | <b>1.109.671.579</b>             | <b>40.685.992</b>                       | <b>128.096.185</b>  |
| <b>ERTRÄGE</b>   |               |                                   |                                  |   |   |
| Anlageerträge, netto   |               | 55.589.950                        | 67.544.884                       | 2.416.714                               | 9.028.304   |
| Bankzinsen   |               | 454.271                           | 518.231                          | 17.370                                  | 30.499  |
| Sonstige Erträge   | 10            | 903.996                           | 1.102.438                        | 32.671                                  | 994.546   |
| <b>Summe Erträge</b>   |               | <b>56.948.217</b>                 | <b>69.165.553</b>                | <b>2.466.755</b>                        | <b>10.053.349</b>   |
| <b>AUFWENDUNGEN</b>  |               |                                   |                                  |   |   |
| Verwaltungsgebühren  | 4,b           | (9.463.636)                       | (1.405.258)                      | (359)                                   | (460.540)   |
| Transaktionskosten   | 5             | -                                 | (35.948)                         | (884)                                   | (254)   |
| Betriebskosten, Verwaltungs- und Kontoführungsgebühren                     | 4,d           | (1.946.695)                       | (1.645.281)                      | (83.377)                                | (158.322)   |
| Sonstige Gebühren  |               | (1.209)                           | (1.744)                          | (4)                                     | (311)   |
| <b>Summe Aufwendungen</b>  |               | <b>(11.411.540)</b>               | <b>(3.088.231)</b>               | <b>(84.624)</b>                         | <b>(619.427)</b>  |
| <b>Nettoanlagegewinn/(-verlust)</b>  |               | <b>45.536.677</b>                 | <b>66.077.322</b>                | <b>2.382.131</b>                        | <b>9.433.922</b>  |
| Realisierter Gewinn/(Verlust) aus:   |               |                                   |                                  |   |   |
| - Anlagen  | 2,e           | (49.622.067)                      | (58.917.807)                     | (1.644.971)                             | (1.569.047)   |
| - Derivaten  |               | (8.068.903)                       | 5.798.115                        | 411.603                                 | (1.397.759)   |
| - Devisengeschäften  |               | (1.429.072)                       | 1.233.231                        | 132.837                                 | 230.836   |
| <b>Realisierter Gewinn/(Verlust) des Geschäftsjahres/Berichtszeitraums</b> |               | <b>(13.583.365)</b>               | <b>14.190.861</b>                | <b>1.281.600</b>                        | <b>6.697.952</b>  |
| Veränderung des nicht realisierten Bewertungsergebnisses aus:              |               |                                   |                                  |   |   |
| - Anlagen  |               | 61.340.444                        | 92.935.164                       | 2.950.995                               | 6.128.833   |
| - Derivaten  |               | (1.845.274)                       | (5.099.970)                      | (205.396)                               | 15.898  |
| <b>Veränderung des Nettovermögens aufgrund der Geschäftstätigkeit</b>      |               | <b>45.911.805</b>                 | <b>102.026.055</b>               | <b>4.027.199</b>                        | <b>12.842.683</b>   |
| Erlöse aus der Ausgabe von Anteilen  |               | 542.423.847                       | 202.826.770                      | 8.447.098                               | 11.698.880  |
| Zahlungen bei der Rücknahme von Anteilen                                   |               | (441.072.665)                     | (631.909.708)                    | (16.109.718)                            | (71.285.234)  |
| Dividendenzahlungen  | 9             | (51.465.723)                      | (57.230.474)                     | (2.383.441)                             | (3.100)   |
| Währungsumrechnung   | 2,f           | -                                 | -                                | -                                       | -   |
| <b>Nettovermögen zum Ende des Jahres/Berichtszeitraums</b>                 |               | <b>885.592.682</b>                | <b>725.384.222</b>               | <b>34.667.130</b>                       | <b>81.349.414</b>   |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens

für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024

| Global Inflation<br>Linked Bond<br>USD | Global<br>Investment<br>Grade<br>Securitized<br>Credit Bond<br>USD | Global Lower<br>Carbon Bond<br>USD | Global<br>Securitized<br>Credit Bond<br>USD | Global Short<br>Duration Bond<br>USD | India Fixed<br>Income<br>USD | RMB Fixed<br>Income<br>USD |
|--|--|------------------------------------|---|--------------------------------------|------------------------------|----------------------------|
| <b>642.492.437</b>                     | <b>1.289.266.469</b>   | <b>154.546.381</b>                 | <b>80.739.259</b>                           | <b>826.600.095</b>                   | <b>536.054.875</b>           | <b>269.969.776</b>         |
| 20.565.030                             | 98.763.872   | 5.844.599                          | 6.365.021                                   | 66.170.707                           | 39.133.484                   | 8.822.948                  |
| 56.396                                 | 327.771  | 326.046                            | 36.495                                      | 313.884                              | 323.310                      | 21.982                     |
| 44.079                                 | 2.790.906  | 219.237                            | 138.705                                     | 1.701.840                            | 623.007                      | 234.302                    |
| <b>20.665.505</b>                      | <b>101.882.549</b>   | <b>6.389.882</b>                   | <b>6.540.221</b>                            | <b>68.186.431</b>                    | <b>40.079.801</b>            | <b>9.079.232</b>           |
| (354.752)                              | (3.767.692)  | (1.007.483)                        | (245.680)                                   | (6.523.116)                          | (6.456.125)                  | (1.477.917)                |
| (45)                                   | -  | (803)                              | -   | (8.695)                              | (7.400)                      | -                          |
| (778.357)                              | (2.446.464)  | (430.412)                          | (152.099)                                   | (2.801.841)                          | (2.164.947)                  | (548.759)                  |
| (433)                                  | (3)  | (461)                              | -   | (2.239)                              | -                            | (67)                       |
| <b>(1.133.587)</b>                     | <b>(6.214.159)</b>   | <b>(1.439.159)</b>                 | <b>(397.779)</b>                            | <b>(9.335.891)</b>                   | <b>(8.628.472)</b>           | <b>(2.026.743)</b>         |
| <b>19.531.918</b>                      | <b>95.668.390</b>  | <b>4.950.723</b>                   | <b>6.142.442</b>                            | <b>58.850.540</b>                    | <b>31.451.329</b>            | <b>7.052.489</b>           |
| (7.261.025)                            | (8.065.614)  | (4.985.763)                        | (205.988)                                   | (2.700.689)                          | (6.311.905)                  | (5.236.918)                |
| 2.574.700                              | 11.144.762   | (497.386)                          | (4.145.092)                                 | 5.557.865                            | (2.258.082)                  | (1.950.668)                |
| (831.497)                              | 3.300.471  | (275.853)                          | 167.329                                     | (5.636.475)                          | (8.511.061)                  | (9.223.811)                |
| <b>14.014.096</b>                      | <b>102.048.009</b>   | <b>(808.279)</b>                   | <b>1.958.691</b>                            | <b>56.071.241</b>                    | <b>14.370.281</b>            | <b>(9.358.908)</b>         |
| (10.269.440)                           | 53.962.172   | 11.973.245                         | 3.769.787                                   | 33.679.468                           | 13.538.451                   | 4.628.203                  |
| (2.704.645)                            | (8.002.775)  | 456.366                            | 142.389                                     | (5.671.170)                          | (1.995.902)                  | (1.027.689)                |
| <b>1.040.011</b>                       | <b>148.007.406</b>   | <b>11.621.332</b>                  | <b>5.870.867</b>                            | <b>84.079.539</b>                    | <b>25.912.830</b>            | <b>(5.758.394)</b>         |
| 123.793.554                            | 1.785.987.320  | 205.523.724                        | 13.942.572                                  | 3.311.269.441                        | 751.488.081                  | 77.494.104                 |
| (167.665.636)                          | (1.229.712.001)  | (114.793.066)                      | (7.336.732)                                 | (1.893.642.682)                      | (473.097.238)                | (118.729.518)              |
| (15.831.382)                           | (70.011.383)   | (8.137.439)                        | (3.543.445)                                 | (80.252.073)                         | (39.284.850)                 | (3.921.756)                |
| -                                      | -  | -                                  | -   | -                                    | -                            | -                          |
| <b>583.828.984</b>                     | <b>1.923.537.811</b>   | <b>248.760.932</b>                 | <b>89.672.521</b>                           | <b>2.248.054.320</b>                 | <b>801.073.698</b>           | <b>219.054.212</b>         |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



# Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens

für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024

|  | Erläuterungen | Singapore<br>Dollar Income<br>Bond<br>SGD | Ultra Short<br>Duration Bond<br>USD | US Dollar<br>Bond<br>USD | US High Yield<br>Bond<br>USD |
|--|---------------|---|-------------------------------------|--------------------------|------------------------------|
| <b>Nettovermögen zu Beginn des Jahres/Berichtszeitraums</b>                |               | <b>192.593.971</b>                        | <b>764.078.587</b>                  | <b>126.475.751</b>       | <b>46.163.625</b>            |
| <b>ERTRÄGE</b>   |               |   |                                     |                          |                              |
| Anlageerträge, netto   |               | 9.569.810                                 | 44.359.479                          | 10.372.014               | 2.898.829                    |
| Bankzinsen   |               | 68.806                                    | 152.482                             | 47.711                   | 5.654                        |
| Sonstige Erträge   | 10            | 134.578                                   | 468.156                             | 266.380                  | 41.352                       |
| <b>Summe Erträge</b>   |               | <b>9.773.194</b>                          | <b>44.980.117</b>                   | <b>10.686.105</b>        | <b>2.945.835</b>             |
| <b>AUFWENDUNGEN</b>  |               |   |                                     |                          |                              |
| Verwaltungsgebühren  | 4,b           | (1.723.566)                               | (2.019.805)                         | (1.563.449)              | (151.813)                    |
| Transaktionskosten   | 5             | -   | -                                   | -                        | -                            |
| Betriebskosten, Verwaltungs- und Kontoführungsgebühren                     | 4,d           | (444.841)                                 | (1.269.254)                         | (565.484)                | (92.391)                     |
| Sonstige Gebühren  |               | (1.208)                                   | -                                   | (15)                     | -                            |
| <b>Summe Aufwendungen</b>  |               | <b>(2.169.615)</b>                        | <b>(3.289.059)</b>                  | <b>(2.128.948)</b>       | <b>(244.204)</b>             |
| <b>Nettoanlagegewinn/(-verlust)</b>  |               | <b>7.603.579</b>                          | <b>41.691.058</b>                   | <b>8.557.157</b>         | <b>2.701.631</b>             |
| Realisierter Gewinn/(Verlust) aus:   |               |   |                                     |                          |                              |
| - Anlagen  | 2,e           | (10.313.513)                              | 22.734                              | (7.558.373)              | (2.462.528)                  |
| - Derivaten  |               | (2.163.418)                               | 6.812.640                           | (145.851)                | (268.122)                    |
| - Devisengeschäften  |               | 2.168.591                                 | (420.455)                           | (4.724)                  | (4.646)                      |
| <b>Realisierter Gewinn/(Verlust) des Geschäftsjahres/Berichtszeitraums</b> |               | <b>(2.704.761)</b>                        | <b>48.105.977</b>                   | <b>848.209</b>           | <b>(33.665)</b>              |
| Veränderung des nicht realisierten Bewertungsergebnisses aus:              |               |   |                                     |                          |                              |
| - Anlagen  |               | 15.853.495                                | 11.653.178                          | 949.083                  | 3.330.440                    |
| - Derivaten  |               | (93.984)                                  | (2.339.529)                         | (135.541)                | (47.824)                     |
| <b>Veränderung des Nettovermögens aufgrund der Geschäftstätigkeit</b>      |               | <b>13.054.750</b>                         | <b>57.419.626</b>                   | <b>1.661.751</b>         | <b>3.248.951</b>             |
| Erlöse aus der Ausgabe von Anteilen  |               | 90.674.323                                | 1.554.145.803                       | 481.177.086              | 11.266.386                   |
| Zahlungen bei der Rücknahme von Anteilen                                   |               | (34.331.948)                              | (1.272.760.091)                     | (263.972.208)            | (16.448.771)                 |
| Dividendenzahlungen  | 9             | (11.036.148)                              | (20.420.802)                        | (10.891.068)             | (993.240)                    |
| Währungsumrechnung   | 2,f           | -   | -                                   | -                        | -                            |
| <b>Nettovermögen zum Ende des Jahres/Berichtszeitraums</b>                 |               | <b>250.954.948</b>                        | <b>1.082.463.123</b>                | <b>334.451.312</b>       | <b>43.236.951</b>            |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens

für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024

| Sonstige Teilfonds                     |   |  |  |   |   |   |
|--|---|--|--|---|---|---|
| US Short Duration High Yield Bond* USD | Global Credit Floating Rate Fixed Term Bond 2023 – 1 (geschlossen zum 5. Juli 2023) USD | Global Credit Floating Rate Fixed Term Bond 2023 – 2 (geschlossen zum 29. Dezember 2023) USD | Global Emerging Markets Multi-Asset Income** USD | Managed Solutions – Asia Focused Conservative USD | Managed Solutions – Asia Focused Growth USD | Managed Solutions – Asia Focused Income USD |
| 103.256.574                            | 557.703.344   | 394.326.735  | 53.475.476                                       | 47.888.112  | 27.686.618                                  | 420.838.099                                 |
| 6.345.987                              | 8.812.269   | 14.855.964   | 3.331.093  | 1.990.557   | 993.805                                     | 18.760.518                                  |
| 42.477                                 | 456.308   | 451.760  | 33.597   | 14.192  | 6.275                                       | 194.562                                     |
| 77.445                                 | 16.149  | 182.265  | 40.794   | 85.400  | 26.950                                      | 64.223                                      |
| <b>6.465.909</b>                       | <b>9.284.726</b>  | <b>15.489.989</b>  | <b>3.405.484</b>                                 | <b>2.090.149</b>                                  | <b>1.027.030</b>                            | <b>19.019.303</b>                           |
| (174.484)                              | (307.122)   | (620.732)  | (678.769)  | (275.572)   | (349.801)                                   | (4.273.114)                                 |
| -                                      | (24.695)  | (205.668)  | (35.210)   | (64)  | (62.267)                                    | (372.756)                                   |
| (215.714)                              | (194.490)   | (317.030)  | (177.858)  | (138.902)   | (82.608)                                    | (1.210.081)                                 |
| (98)                                   | -   | -  | (41)   | (291)   | (264)                                       | (3.141)                                     |
| <b>(390.296)</b>                       | <b>(526.307)</b>  | <b>(1.143.430)</b>   | <b>(891.878)</b>                                 | <b>(414.829)</b>                                  | <b>(494.940)</b>                            | <b>(5.859.092)</b>                          |
| <b>6.075.613</b>                       | <b>8.758.419</b>  | <b>14.346.559</b>  | <b>2.513.606</b>                                 | <b>1.675.320</b>                                  | <b>532.090</b>                              | <b>13.160.211</b>                           |
| (3.733.286)                            | (25.457.576)  | (20.426.959)   | (1.104.628)                                      | (3.842.438)                                       | (4.073.401)                                 | (35.032.553)                                |
| (279.153)                              | 15.811.163  | 5.594.129  | (608.969)  | (143.344)   | (113.196)                                   | (2.794.637)                                 |
| 468.071                                | (24.820)  | (413.981)  | 210.399  | 8.873   | (12.525)                                    | (2.125.522)                                 |
| <b>2.531.245</b>                       | <b>(912.814)</b>  | <b>(900.252)</b>   | <b>1.010.408</b>                                 | <b>(2.301.589)</b>                                | <b>(3.667.032)</b>                          | <b>(26.792.501)</b>                         |
| 5.985.140                              | 26.946.352  | 23.832.075   | 1.669.399  | 2.986.314   | 3.558.942                                   | 30.294.301                                  |
| (370.797)                              | (15.058.053)  | (11.801.032)   | (206.155)  | (88.790)  | (52.497)                                    | (876.757)                                   |
| <b>8.145.588</b>                       | <b>10.975.485</b>   | <b>11.130.791</b>  | <b>2.473.652</b>                                 | <b>595.935</b>                                    | <b>(160.587)</b>                            | <b>2.625.043</b>                            |
| 22.963.085                             | -   | -  | 12.363.596                                       | 22.925.323  | 5.508.935                                   | 155.556.674                                 |
| (35.868.720)                           | (559.279.008)   | (389.194.709)  | (17.637.625)                                     | (37.647.192)                                      | (14.589.222)                                | (283.531.006)                               |
| (4.928.668)                            | (9.399.821)   | (16.262.817)   | (3.194.007)                                      | (1.486.760)                                       | (91.976)                                    | (18.055.212)                                |
| -                                      | -   | -  | -  | -   | -   | -   |
| <b>93.567.859</b>                      | <b>-</b>  | <b>-</b>   | <b>47.481.092</b>                                | <b>32.275.418</b>                                 | <b>18.353.768</b>                           | <b>277.433.598</b>                          |

\* Bis zum 2. Juli 2023 lautete der Name des Teilfonds „Global Short Duration High Yield Bond“.

\*\* Aufgrund der Marktgegebenheiten infolge der Ukraine- und Russland-Krise seit dem 25. Februar 2022 haben der Ausschuss für die Preisbestimmung und die Verwaltungsgesellschaft vereinbart und veranlasst, dass alle auf Rubel lautenden russischen Aktien im Anlageportfolio auf null abgeschrieben werden.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens

für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024

|  | Erläuterungen | Multi-Asset Style<br>Factors<br>EUR | Multi-Strategy<br>Target Return<br>EUR | US Income<br>Focused<br>USD |
|--|---------------|-------------------------------------|--|-----------------------------|
| <b>Nettovermögen zu Beginn des Jahres/Berichtszeitraums</b>                |               | <b>1.166.556.888</b>                | <b>108.915.477</b>                     | <b>408.772.242</b>          |
| <b>ERTRÄGE</b>   |               |                                     |  |                             |
| Anlageerträge, netto   |               | 412.316.830                         | 2.872.999                              | 17.945.667                  |
| Bankzinsen   |               | 1.475.796                           | 188.753                                | 936.751                     |
| Sonstige Erträge   | 10            | 564.535                             | 29.660                                 | 573.471                     |
| <b>Summe Erträge</b>   |               | <b>414.357.161</b>                  | <b>3.091.412</b>                       | <b>19.455.889</b>           |
| <b>AUFWENDUNGEN</b>  |               |                                     |  |                             |
| Verwaltungsgebühren  | 4,b           | (2.527.580)                         | (68.457)                               | (6.055.977)                 |
| Transaktionskosten   | 5             | -                                   | (31.184)                               | (113.731)                   |
| Betriebskosten, Verwaltungs- und Kontoführungsgebühren                     | 4,d           | (1.282.059)                         | (187.221)                              | (1.233.241)                 |
| Sonstige Gebühren  |               | -                                   | (195)                                  | -                           |
| <b>Summe Aufwendungen</b>  |               | <b>(3.809.639)</b>                  | <b>(287.057)</b>                       | <b>(7.402.949)</b>          |
| <b>Nettoanlagegewinn/(-verlust)</b>  |               | <b>410.547.522</b>                  | <b>2.804.355</b>                       | <b>12.052.940</b>           |
| Realisierter Gewinn/(Verlust) aus:   |               |                                     |  |                             |
| - Anlagen  | 2,e           | 376.269                             | (1.046.356)                            | (4.444.758)                 |
| - Derivaten  |               | 4.775.529                           | 7.276.438                              | (1.272.783)                 |
| - Devisengeschäften  |               | (377.097.947)                       | (65.285)                               | (32.214)                    |
| <b>Realisierter Gewinn/(Verlust) des Geschäftsjahres/Berichtszeitraums</b> |               | <b>38.601.373</b>                   | <b>8.969.152</b>                       | <b>6.303.185</b>            |
| Veränderung des nicht realisierten Bewertungsergebnisses aus:              |               |                                     |  |                             |
| - Anlagen  |               | 5.391.345                           | 1.453.049                              | 56.636.853                  |
| - Derivaten  |               | 21.988.486                          | 1.299.969                              | (1.321.924)                 |
| <b>Veränderung des Nettovermögens aufgrund der Geschäftstätigkeit</b>      |               | <b>65.981.204</b>                   | <b>11.722.170</b>                      | <b>61.618.114</b>           |
| Erlöse aus der Ausgabe von Anteilen  |               | 85.334.222                          | 26.519.806                             | 831.248.632                 |
| Zahlungen bei der Rücknahme von Anteilen                                   |               | (495.732.329)                       | (37.157.667)                           | (764.689.582)               |
| Dividendenzahlungen  | 9             | -                                   | (62)                                   | (25.843.842)                |
| Währungsumrechnung   | 2,f           | -                                   | -                                      | -                           |
| <b>Nettovermögen zum Ende des Jahres/Berichtszeitraums</b>                 |               | <b>822.139.985</b>                  | <b>109.999,724*</b>                    | <b>511.105.564</b>          |

\* Das Gesamtnettovermögen des Teilfonds und der Nettoinventarwert je Anteil der Anteilklassen IC, ICH GBP und ID wurden für das Berichtsjahr angepasst, nachdem nach dem Ende des Jahres am 16. April 2024 eine überhöhte Abgrenzung der aufgelaufenen Verwaltungsgebühren von insgesamt 122,656 USD festgestellt wurde,

## Inhaltsverzeichnis: Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

| Name des Teilfonds   | Seitenzahl | Name des Teilfonds                              | Seitenzahl |
|--|------------|---|------------|
| ASEAN Equity *   | 75         | Global Inflation Linked Bond                    | 274        |
| Asia ex Japan Equity   | 76         | Global Investment Grade Securitised Credit Bond | 277        |
| Asia ex Japan Equity Smaller Companies                               | 78         | Global Lower Carbon Bond                        | 284        |
| Asia Pacific ex Japan Equity High Dividend                           | 80         | Global Securitised Credit Bond                  | 290        |
| China A-Shares Equity  | 81         | Global Short Duration Bond                      | 293        |
| Chinese Equity   | 82         | India Fixed Income                              | 302        |
| Euroland Equity Smaller Companies                                    | 84         | RMB Fixed Income                                | 304        |
| Euroland Growth  | 86         | Singapore Dollar Income Bond                    | 308        |
| Euroland Value   | 87         | Ultra Short Duration Bond                       | 313        |
| Europe Value   | 88         | US Dollar Bond                                  | 321        |
| Global Emerging Markets Equity                                       | 90         | US High Yield Bond                              | 325        |
| Global Equity Circular Economy                                       | 92         | US Short Duration High Yield Bond**             | 330        |
| Global Equity Climate Change   | 94         | Global Emerging Markets Multi-Asset Income      | 334        |
| Global Equity Sustainable Healthcare                                 | 95         | Managed Solutions – Asia Focused Conservative   | 341        |
| Global Infrastructure Equity   | 96         | Managed Solutions – Asia Focused Growth         | 344        |
| Global Real Estate Equity  | 98         | Managed Solutions – Asia Focused Income         | 346        |
| Global Lower Carbon Equity   | 100        | Multi-Asset Style Factors                       | 357        |
| Global Sustainable Equity Income                                     | 104        | Multi-Strategy Target Return                    | 359        |
| Global Sustainable Long Term Dividend                                | 107        | US Income Focused                               | 360        |
| Global Sustainable Long Term Equity                                  | 108        |   |            |
| Hong Kong Equity   | 109        |   |            |
| BRIC Equity  | 111        |   |            |
| BRIC Markets Equity  | 113        |   |            |
| Frontier Markets   | 115        |   |            |
| Global Equity Volatility Focused                                     | 117        |   |            |
| Brazil Equity  | 123        |   |            |
| Economic Scale US Equity   | 124        |   |            |
| Indian Equity  | 137        |   |            |
| Russia Equity  | 138        |   |            |
| Turkey Equity  | 139        |   |            |
| Asia Bond  | 140        |   |            |
| Asia ESG Bond  | 148        |   |            |
| Asia High Yield Bond   | 152        |   |            |
| Asian Currencies Bond  | 157        |   |            |
| Brazil Bond  | 161        |   |            |
| Corporate Euro Bond Fixed Term 2027<br>(aufgelegt zum 30. Juni 2023) | 162        |   |            |
| Euro Bond  | 165        |   |            |
| Euro Bond Total Return   | 168        |   |            |
| Euro Credit Bond   | 170        |   |            |
| Euro High Yield Bond   | 173        |   |            |
| ESG Short Duration Credit Bond                                       | 176        |   |            |
| GEM Debt Total Return  | 179        |   |            |
| Global Bond  | 182        |   |            |
| Global Bond Total Return   | 187        |   |            |
| Global Corporate Bond  | 193        |   |            |
| Global Emerging Markets Bond   | 206        |   |            |
| Global Emerging Markets Corporate Sustainable<br>Anleihe             | 213        |   |            |
| Global Emerging Markets ESG Bond                                     | 216        |   |            |
| Global Emerging Markets ESG Local Debt                               | 222        |   |            |
| Global Emerging Markets Local Debt                                   | 225        |   |            |
| Global ESG Corporate Bond  | 228        |   |            |
| Global Government Bond   | 235        |   |            |
| Global Green Bond  | 241        |   |            |
| Global High Income Bond  | 244        |   |            |
| Global High Yield Bond   | 258        |   |            |
| Global High Yield ESG Bond   | 267        |   |            |
| Global High Yield Securitised Credit Bond                            | 272        |   |            |

\* Bis zum 31. Juli 2023 lautete der Name des Teilfonds „Thai Equity“.

\*\* Bis zum 2. Juli 2023 lautete der Name des Teilfonds „Global Short Duration High Yield Bond“.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

ASEAN Equity\*

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl     | Wäh-<br>rung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens | Beschreibung  | Anzahl  | Wäh-<br>rung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |
|---|------------|--------------|------------------|-----------------------------------|---|---------|--------------|-------------------|-----------------------------------|
| <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>  |            |              |                  |                                   | <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>  |         |              |                   |                                   |
| <b>AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |            |              |                  |                                   | <b>AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>               |         |              |                   |                                   |
| <b>AKTIEN</b>   |            |              |                  |                                   | <b>AKTIEN</b>   |         |              |                   |                                   |
| <b>HONGKONG</b>   |            |              |                  |                                   | <b>SINGAPUR</b>   |         |              |                   |                                   |
| AIA GROUP   | 60.400     | HKD          | 405.688          | 1,48                              | SEA LTD   | 22.929  | USD          | 1.220.740         | 4,44                              |
|   |            |              | <b>405.688</b>   | <b>1,48</b>                       |   |         |              | <b>1.220.740</b>  | <b>4,44</b>                       |
| <b>INDONESIEN</b>   |            |              |                  |                                   | <b>SUMME DEPOSITARY RECEIPTS</b>  |         |              |                   |                                   |
| AVIA AVIAN  | 13.894.300 | IDR          | 481.985          | 1,75                              | <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTEN WERTPAPIERE WERTPAPIERE</b>     |         |              | <b>26.847.475</b> | <b>97,64</b>                      |
| BANK MANDIRI  | 3.235.900  | IDR          | 1.464.370        | 5,33                              | <b>AN EINEM ANDEREM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE, ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>    |         |              |                   |                                   |
| BANK RAKYAT INDONESIA TELEKOMUNIKASI                              | 5.481.400  | IDR          | 2.160.753        | 7,86                              | <b>AKTIEN</b>   |         |              |                   |                                   |
| INDONESIA PERSERO „B“   | 4.915.100  | IDR          | 1.081.911        | 3,93                              | <b>THAILAND</b>   |         |              |                   |                                   |
| UNILEVER INDONESIA  | 1.954.400  | IDR          | 336.519          | 1,22                              | AIRPORTS OF THAILAND  | 226.100 | THB          | 406.744           | 1,48                              |
|   |            |              | <b>5.525.538</b> | <b>20,09</b>                      |   |         |              | <b>406.744</b>    | <b>1,48</b>                       |
| <b>MALAYSIA</b>   |            |              |                  |                                   | <b>SUMME AKTIEN</b>   |         |              |                   |                                   |
| CIMB GROUP HOLDINGS   | 920.300    | MYR          | 1.273.603        | 4,62                              | <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN MARKT GEHANDELTEN ÜBERTRAGBAREN WERTPAPIERE</b> |         |              | <b>406.744</b>    | <b>1,48</b>                       |
| IHH HEALTHCARE  | 608.100    | MYR          | 774.740          | 2,82                              | <b>SUMME WERTPAPIERANLAGEN</b>  |         |              | <b>27.254.219</b> | <b>99,12</b>                      |
| INARI AMERTON   | 522.800    | MYR          | 349.049          | 1,27                              | <b>SONSTIGES NETTOVERMÖGEN</b>  |         |              | <b>242.740</b>    | <b>0,88</b>                       |
| MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS  | 312.300    | MYR          | 653.237          | 2,38                              | <b>GESAMTNETTOVERMÖGEN</b>  |         |              | <b>27.496.959</b> | <b>100,00</b>                     |
|   |            |              | <b>3.050.629</b> | <b>11,09</b>                      |   |         |              |                   |                                   |
| <b>PHILIPPINEN</b>  |            |              |                  |                                   |   |         |              |                   |                                   |
| BDO UNIBANK   | 400.160    | PHP          | 1.099.791        | 4,00                              |   |         |              |                   |                                   |
| GLOBE TELECOM   | 18.005     | PHP          | 566.590          | 2,06                              |   |         |              |                   |                                   |
| INTERNATIONAL CONTAINER TERMINAL                                  | 94.860     | PHP          | 536.609          | 1,95                              |   |         |              |                   |                                   |
| SM PRIME HOLDINGS   | 1.393.500  | PHP          | 810.592          | 2,95                              |   |         |              |                   |                                   |
| WILCON DEPOT  | 1.053.700  | PHP          | 333.270          | 1,21                              |   |         |              |                   |                                   |
|   |            |              | <b>3.346.852</b> | <b>12,17</b>                      |   |         |              |                   |                                   |
| <b>SINGAPUR</b>   |            |              |                  |                                   |   |         |              |                   |                                   |
| CAPITALAND INVESTMENT   | 313.900    | SGD          | 640.208          | 2,33                              |   |         |              |                   |                                   |
| CAPITAMALL REIT   | 598.300    | SGD          | 883.018          | 3,21                              |   |         |              |                   |                                   |
| DBS GROUP   | 103.000    | SGD          | 2.798.153        | 10,18                             |   |         |              |                   |                                   |
| GRAB HOLDINGS   | 232.761    | USD          | 734.361          | 2,67                              |   |         |              |                   |                                   |
| OVERSEAS CHINESE BANKING CORP                                     | 224.800    | SGD          | 2.290.764        | 8,33                              |   |         |              |                   |                                   |
| SATS  | 322.100    | SGD          | 604.378          | 2,20                              |   |         |              |                   |                                   |
| SINGAPUR TELEKOMMUNIKATION  | 415.600    | SGD          | 782.901          | 2,85                              |   |         |              |                   |                                   |
| UNITED OVERSEAS BANK  | 49.000     | SGD          | 1.078.592        | 3,92                              |   |         |              |                   |                                   |
|   |            |              | <b>9.812.375</b> | <b>35,69</b>                      |   |         |              |                   |                                   |
| <b>THAILAND</b>   |            |              |                  |                                   |   |         |              |                   |                                   |
| BUMRUNGRAD HOSPITAL FOREIGN                                       | 124.800    | THB          | 767.789          | 2,78                              |   |         |              |                   |                                   |
| CENTRAL RETAIL  | 639.100    | THB          | 631.903          | 2,30                              |   |         |              |                   |                                   |
| DELTA ELECTRONICS   |            |              |                  |                                   |   |         |              |                   |                                   |
| THAILAND  | 118.000    | THB          | 238.204          | 0,87                              |   |         |              |                   |                                   |
| HOME PRODUCT CENTER   | 2.495.100  | THB          | 746.954          | 2,72                              |   |         |              |                   |                                   |

\* Bis zum 31. Juli 2023 lautete der Name des Teilfonds „Thai Equity“.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Asia ex Japan Equity  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl     | Wäh-<br>rung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens | Beschreibung  | Anzahl  | Wäh-<br>rung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |
|---|------------|--------------|-------------------|-----------------------------------|---|---------|--------------|--------------------|-----------------------------------|
| <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>  |            |              |                   |                                   | <b>SINGAPUR</b>   |         |              |                    |                                   |
| <b>AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |            |              |                   |                                   | DBS GROUP   |         |              |                    |                                   |
| <b>AKTIEN</b>   |            |              |                   |                                   | SINGAPUR  |         |              |                    |                                   |
| <b>CHINA</b>  |            |              |                   |                                   | TELEKOMMUNIKATION   |         |              |                    |                                   |
| ALIBABA GROUP HOLDING   | 843.300    | HKD          | 7.569.438         | 2,46                              |   | 209.000 | SGD          | 5.579.631          | 1,82                              |
| BYD „H“   | 151.500    | HKD          | 3.902.459         | 1,27                              |   | 857.400 | SGD          | 1.607.307          | 0,52                              |
| CHINA CONSTRUCTION BANK „H“                                       | 12.205.000 | HKD          | 7.360.630         | 2,39                              |   |         |              | <b>7.186.938</b>   | <b>2,34</b>                       |
| CHINA MERCHANTS BANK „H“  | 1.272.000  | HKD          | 5.030.173         | 1,64                              | <b>SÜDKOREA</b>   |         |              |                    |                                   |
| MEITUAN DIANPING  | 127.340    | HKD          | 1.574.981         | 0,51                              | CLASSYS   |         |              |                    |                                   |
| NETEASE   | 354.700    | HKD          | 7.378.206         | 2,40                              | HYUNDAI MOTOR   |         |              |                    |                                   |
| PING AN INSURANCE „H“   | 772.000    | HKD          | 3.260.048         | 1,06                              | KB FINANCIAL GROUP  |         |              |                    |                                   |
| SHANGHAI SIYUAN ELECTRIC  | 528.300    | CNY          | 4.255.668         | 1,38                              | SAMSUNG ELECTRONICS   |         |              |                    |                                   |
| SHENZHEN MINDRAY BIO  |            |              |                   |                                   | SK HYNIX  |         |              |                    |                                   |
| MEDICAL ELECTRONICS   | 103.101    | CNY          | 3.992.686         | 1,30                              | SK SQUARE   |         |              |                    |                                   |
| TENCENT HOLDINGS  | 474.300    | HKD          | 18.410.945        | 5,99                              |   |         |              | <b>48.686.840</b>  | <b>15,84</b>                      |
| TRIP COM GROUP  | 114.150    | HKD          | 5.034.796         | 1,64                              | <b>TAIWAN</b>   |         |              |                    |                                   |
| WEICHAI POWER   | 336.200    | CNY          | 758.694           | 0,25                              | ALCHIP TECHNOLOGIES   |         |              |                    |                                   |
| WEICHAI POWER „H“   | 1.626.000  | HKD          | 3.099.735         | 1,01                              | LARGAN PRECISION  |         |              |                    |                                   |
| ZIJIN MINING GROUP „H“  | 2.494.000  | HKD          | 4.977.516         | 1,62                              | MEDIATEK  |         |              |                    |                                   |
|   |            |              | <b>76.605.975</b> | <b>24,92</b>                      | QUANTA COMPUTER   |         |              |                    |                                   |
|   |            |              |                   |                                   | TAIWAN SEMICONDUCTOR  |         |              |                    |                                   |
|   |            |              |                   |                                   | VERARBEITENDES GEWERBE  |         |              |                    |                                   |
|   |            |              |                   |                                   | UNIMICRON TECHNOLOGY  |         |              |                    |                                   |
|   |            |              |                   |                                   | YAGEO CORP  |         |              |                    |                                   |
|   |            |              |                   |                                   |   |         |              | <b>55.850.731</b>  | <b>18,16</b>                      |
|   |            |              |                   |                                   | <b>THAILAND</b>   |         |              |                    |                                   |
|   |            |              |                   |                                   | BUMRUNGRAD HOSPITAL   |         |              |                    |                                   |
|   |            |              |                   |                                   | FOREIGN   |         |              |                    |                                   |
|   |            |              |                   |                                   | PTT E&P   |         |              |                    |                                   |
|   |            |              |                   |                                   |   |         |              | <b>5.325.873</b>   | <b>1,73</b>                       |
|   |            |              |                   |                                   | <b>SUMME AKTIEN</b>   |         |              |                    |                                   |
|   |            |              |                   |                                   |   |         |              | <b>284.224.649</b> | <b>92,44</b>                      |
|   |            |              |                   |                                   | <b>DEPOSITARY RECEIPTS</b>                                      |         |              |                    |                                   |
|   |            |              |                   |                                   | <b>CHINA</b>  |         |              |                    |                                   |
|   |            |              |                   |                                   | PINDUODUO   |         |              |                    |                                   |
|   |            |              |                   |                                   | TENCENT MUSIC   |         |              |                    |                                   |
|   |            |              |                   |                                   | ENTERTAINMENT GROUP   |         |              |                    |                                   |
|   |            |              |                   |                                   |   |         |              | <b>8.753.975</b>   | <b>2,85</b>                       |
|   |            |              |                   |                                   | <b>SINGAPUR</b>   |         |              |                    |                                   |
|   |            |              |                   |                                   | SEA LTD   |         |              |                    |                                   |
|   |            |              |                   |                                   |   |         |              | <b>3.636.103</b>   | <b>1,18</b>                       |
|   |            |              |                   |                                   | <b>SUMME DEPOSITARY RECEIPTS</b>                                |         |              |                    |                                   |
|   |            |              |                   |                                   |   |         |              | <b>12.390.078</b>  | <b>4,03</b>                       |
|   |            |              |                   |                                   | <b>VORZUGSAKTIEN</b>  |         |              |                    |                                   |
|   |            |              |                   |                                   | <b>SÜDKOREA</b>   |         |              |                    |                                   |
|   |            |              |                   |                                   | SAMSUNG ELECTRONICS   |         |              |                    |                                   |
|   |            |              |                   |                                   |   |         |              | <b>2.361.596</b>   | <b>0,77</b>                       |
|   |            |              |                   |                                   | <b>SUMME VORZUGSAKTIEN</b>                                      |         |              |                    |                                   |
|   |            |              |                   |                                   | <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTEN WERTPAPIERE</b> |         |              |                    |                                   |
|   |            |              |                   |                                   |   |         |              | <b>298.976.323</b> | <b>97,24</b>                      |
|   |            |              |                   |                                   | <b>WERTPAPIERE</b>  |         |              |                    |                                   |
|   |            |              |                   |                                   |   |         |              |                    |                                   |
|   |            |              |                   |                                   |   |         |              | <b>9.018.716</b>   | <b>2,93</b>                       |
|   |            |              |                   |                                   |   |         |              | <b>9.018.716</b>   | <b>2,93</b>                       |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Asia ex Japan Equity (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl    | Wäh-<br>rung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |
|---|-----------|--------------|--------------------|-----------------------------------|
| <b>AN EINEM ANDEREM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE, ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>        |           |              |                    |                                   |
| <b>AKTIEN</b>   |           |              |                    |                                   |
| <b>TAIWAN</b>   |           |              |                    |                                   |
| E INK HOLDINGS  | 313.000   | TWD          | 2.220.101          | 0,72                              |
|   |           |              | <u>2.220.101</u>   | <u>0,72</u>                       |
| <b>SUMME AKTIEN</b>   |           |              | <u>2.220.101</u>   | <u>0,72</u>                       |
| <b>DEPOSITARY RECEIPTS</b>  |           |              |                    |                                   |
| <b>TAIWAN</b>   |           |              |                    |                                   |
| ALCHIP TECHNOLOGIES   | 19.408    | USD          | 1.911.688          | 0,62                              |
|   |           |              | <u>1.911.688</u>   | <u>0,62</u>                       |
| <b>SUMME DEPOSITARY RECEIPTS</b>  |           |              | <u>1.911.688</u>   | <u>0,62</u>                       |
| <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN<br/>MARKT GEHANDELTEN ÜBERTRAGBAREN WERTPAPIERE</b> |           |              | <u>4.131.789</u>   | <u>1,34</u>                       |
| <b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>  |           |              |                    |                                   |
| <b>IRLAND</b>   |           |              |                    |                                   |
| HSBC GLOBAL LIQUIDITY<br>FUND   | 1.005.897 | USD          | 1.005.897          | 0,33                              |
|   |           |              | <u>1.005.897</u>   | <u>0,33</u>                       |
| <b>SUMME ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>                                      |           |              | <u>1.005.897</u>   | <u>0,33</u>                       |
| <b>SUMME WERTPAPIERANLAGEN</b>  |           |              | <u>304.114.009</u> | <u>98,91</u>                      |
| <b>SONSTIGES NETTOVERMÖGEN</b>  |           |              | <u>3.346.683</u>   | <u>1,09</u>                       |
| <b>GESAMTNETTOVERMÖGEN</b>  |           |              | <u>307.460.692</u> | <u>100,00</u>                     |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.





# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Asia ex Japan Equity Smaller Companies (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl     | Wäh-<br>rung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens | Beschreibung  | Anzahl  | Wäh-<br>rung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |
|---|------------|--------------|--------------------|-----------------------------------|---|---------|--------------|--------------------|-----------------------------------|
| SK HYNIX  | 56.050     | KRW          | 7.419.209          | 1,88                              | <b>AN EINEM ANDEREM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE, ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>    |         |              |                    |                                   |
| SK SQUARE   | 27.816     | KRW          | 1.624.021          | 0,41                              | <b>AKTIEN</b>   |         |              |                    |                                   |
| W-SCOPE CHUNGJU PLANT   | 82.380     | KRW          | 2.459.926          | 0,63                              | <b>TAIWAN</b>   |         |              |                    |                                   |
|   |            |              | <b>58.962.069</b>  | <b>15,02</b>                      | E INK HOLDINGS  | 300.000 | TWD          | 2.127.892          | 0,54                              |
| <b>TAIWAN</b>   |            |              |                    |                                   |   |         |              | <b>2.127.892</b>   | <b>0,54</b>                       |
| AIRTAC INTERNATIONAL GROUP                                      | 86.331     | TWD          | 2.994.279          | 0,76                              | <b>SUMME AKTIEN</b>   |         |              | <b>2.127.892</b>   | <b>0,54</b>                       |
| ALCHIP TECHNOLOGIES   | 88.000     | TWD          | 8.702.798          | 2,21                              | <b>DEPOSITARY RECEIPTS</b>  |         |              |                    |                                   |
| ASIA VITAL COMPONENTS   | 368.000    | TWD          | 6.232.318          | 1,59                              | <b>TAIWAN</b>   |         |              |                    |                                   |
| ELITE MATERIAL  | 325.000    | TWD          | 4.092.521          | 1,04                              | ALCHIP TECHNOLOGIES   | 11.579  | USD          | 1.140.532          | 0,29                              |
| EVERGREEN MAR CORP  | 487.000    | TWD          | 2.678.207          | 0,68                              |   |         |              | <b>1.140.532</b>   | <b>0,29</b>                       |
| GOLD CIRCUIT ELECTRONICS  | 414.000    | TWD          | 3.162.873          | 0,81                              | <b>SUMME DEPOSITARY RECEIPTS</b>  |         |              | <b>1.140.532</b>   | <b>0,29</b>                       |
| KURA SUSHI ASIA   | 723.000    | TWD          | 2.360.789          | 0,60                              | <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN MARKT GEHANDELTEN ÜBERTRAGBAREN WERTPAPIERE</b> |         |              | <b>3.268.424</b>   | <b>0,83</b>                       |
| LARGAN PRECISION  | 83.000     | TWD          | 6.302.123          | 1,61                              | <b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>  |         |              |                    |                                   |
| MAKALOT INDUSTRIAL  | 457.000    | TWD          | 5.219.226          | 1,33                              | <b>IRLAND</b>   |         |              |                    |                                   |
| NIEN MADE ENTERPRISE  | 511.000    | TWD          | 5.668.286          | 1,44                              | HSBC GLOBAL LIQUIDITY FUND  | 744.315 | USD          | 744.315            | 0,19                              |
| PARADE TECHNOLOGIES   | 205.000    | TWD          | 5.893.105          | 1,50                              |   |         |              | <b>744.315</b>     | <b>0,19</b>                       |
| POWERTECH TECHNOLOGY  | 317.000    | TWD          | 1.990.938          | 0,51                              | <b>SUMME ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>                                  |         |              | <b>744.315</b>     | <b>0,19</b>                       |
| POYA INTERNATIONAL  | 383.525    | TWD          | 5.961.963          | 1,52                              | <b>SUMME WERTPAPIERANLAGEN</b>  |         |              | <b>384.089.795</b> | <b>97,82</b>                      |
| PRIMAX ELECTRONICS  | 682.000    | TWD          | 1.828.413          | 0,47                              | <b>SONSTIGES NETTOVERMÖGEN</b>  |         |              | <b>8.542.074</b>   | <b>2,18</b>                       |
| SINBON ELECTRONICS  | 488.547    | TWD          | 4.274.319          | 1,09                              | <b>GESAMTNETTOVERMÖGEN</b>  |         |              | <b>392.631.869</b> | <b>100,00</b>                     |
| TOPSCIENTIFIC   | 567.652    | TWD          | 3.875.575          | 0,99                              |   |         |              |                    |                                   |
| UNIMICRON TECHNOLOGY  | 938.000    | TWD          | 5.568.766          | 1,42                              |   |         |              |                    |                                   |
| UNIVERSAL VISION  |            |              |                    |                                   |   |         |              |                    |                                   |
| BIOTECHNOLOGY   | 330.540    | TWD          | 2.819.611          | 0,72                              |   |         |              |                    |                                   |
| YAGEO CORP  | 401.225    | TWD          | 7.446.925          | 1,89                              |   |         |              |                    |                                   |
|   |            |              | <b>87.073.035</b>  | <b>22,18</b>                      |   |         |              |                    |                                   |
| <b>THAILAND</b>   |            |              |                    |                                   |   |         |              |                    |                                   |
| BUMRUNGRAD HOSPITAL FOREIGN                                     | 601.800    | THB          | 3.678.010          | 0,94                              |   |         |              |                    |                                   |
| CPN RETAIL GROWTH   |            |              |                    |                                   |   |         |              |                    |                                   |
| LEASEHOLD REIT  | 3.403.000  | THB          | 997.934            | 0,25                              |   |         |              |                    |                                   |
| NGERN TID LOR   | 6.494.000  | THB          | 3.986.724          | 1,02                              |   |         |              |                    |                                   |
| WHA   | 41.858.000 | THB          | 5.506.500          | 1,40                              |   |         |              |                    |                                   |
|   |            |              | <b>14.169.168</b>  | <b>3,61</b>                       |   |         |              |                    |                                   |
| <b>SUMME AKTIEN</b>   |            |              | <b>374.513.321</b> | <b>95,38</b>                      |   |         |              |                    |                                   |
| <b>DEPOSITARY RECEIPTS</b>                                      |            |              |                    |                                   |   |         |              |                    |                                   |
| <b>CHINA</b>  |            |              |                    |                                   |   |         |              |                    |                                   |
| MINISO GROUP HOLDING  | 195.246    | USD          | 4.006.448          | 1,02                              |   |         |              |                    |                                   |
|   |            |              | <b>4.006.448</b>   | <b>1,02</b>                       |   |         |              |                    |                                   |
| <b>USA</b>  |            |              |                    |                                   |   |         |              |                    |                                   |
| LUFAX HOLDING   | 368.153    | USD          | 1.557.287          | 0,40                              |   |         |              |                    |                                   |
|   |            |              | <b>1.557.287</b>   | <b>0,40</b>                       |   |         |              |                    |                                   |
| <b>SUMME DEPOSITARY RECEIPTS</b>                                |            |              | <b>5.563.735</b>   | <b>1,42</b>                       |   |         |              |                    |                                   |
| <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTEN WERTPAPIERE</b> |            |              | <b>380.077.056</b> | <b>96,80</b>                      |   |         |              |                    |                                   |
| <b>WERTPAPIERE</b>  |            |              |                    |                                   |   |         |              |                    |                                   |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Asia Pacific ex Japan Equity High Dividend  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl     | Wäh-<br>rung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens | Beschreibung  | Anzahl            | Wäh-<br>rung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |
|---|------------|--------------|-------------------|-----------------------------------|---|-------------------|--------------|-------------------|-----------------------------------|
| <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>  |            |              |                   |                                   |   |                   |              |                   |                                   |
| <b>AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |            |              |                   |                                   |   |                   |              |                   |                                   |
| <b>AKTIEN</b>   |            |              |                   |                                   | <b>TAIWAN</b>   |                   |              |                   |                                   |
| <b>AUSTRALIEN</b>   |            |              |                   |                                   | HYUNDAI MOTOR   |                   |              |                   |                                   |
| BHP BILLITON  | 316.283    | AUD          | 9.134.806         | 3,38                              | KB FINANCIAL GROUP  | 172.150           | KRW          | 8.989.523         | 3,33                              |
| SANTOS  | 2.338.614  | AUD          | 11.824.266        | 4,38                              | SK SQUARE   | 130.780           | KRW          | 7.635.512         | 2,83                              |
| SOUTH32   | 5.100.779  | AUD          | 9.983.244         | 3,70                              | SK TELECOM  | 198.119           | KRW          | 7.843.820         | 2,91                              |
| TELSTRA CORP  | 3.646.229  | AUD          | 9.182.167         | 3,40                              |   |                   |              | <b>35.300.543</b> | <b>13,08</b>                      |
|   |            |              | <b>40.124.483</b> | <b>14,86</b>                      | <b>ASE TECHNOLOGY HOLDING</b>                                   |                   |              |                   |                                   |
| <b>CHINA</b>  |            |              |                   |                                   | 335.000 TWD 1.622.479 0,60                                      |                   |              |                   |                                   |
| ALIBABA GROUP HOLDING   | 631.300    | HKD          | 5.666.531         | 2,10                              | 339.000 TWD 2.674.629 0,99                                      |                   |              |                   |                                   |
| BAIDU   | 1.053.200  | HKD          | 13.820.268        | 5,12                              | 230.000 TWD 8.336.588 3,09                                      |                   |              |                   |                                   |
| CHINA STATE CONSTRUCTION INTERNATIONAL                            | 6.456.000  | HKD          | 7.044.604         | 2,61                              | 487.000 TWD 4.260.784 1,58                                      |                   |              |                   |                                   |
| PING AN INSURANCE „H“   | 2.727.500  | HKD          | 11.517.850        | 4,27                              | TAIWAN SEMICONDUCTOR  |                   |              |                   |                                   |
| TINGYI  | 9.218.000  | HKD          | 10.105.532        | 3,74                              | VERARBEITENDES GEWERBE  |                   |              |                   |                                   |
| UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS                                      | 11.534.000 | HKD          | 8.208.623         | 3,04                              | 1.089.161 TWD   | 26.171.038        | 9,68         |                   |                                   |
|   |            |              | <b>56.363.408</b> | <b>20,88</b>                      | 444.000 TWD   | 2.635.962         | 0,98         |                   |                                   |
| <b>HONGKONG</b>   |            |              |                   |                                   | UNITED MICRO ELECTRONICS  |                   |              |                   |                                   |
| AIA GROUP   | 896.600    | HKD          | 6.020.140         | 2,23                              | 3.104.000 TWD   | 5.043.448         | 1,87         |                   |                                   |
| HK EXCHANGES & CLEARING   | 203.000    | HKD          | 5.908.605         | 2,19                              | 188.000 TWD   | 707.860           | 0,26         |                   |                                   |
|   |            |              | <b>11.928.745</b> | <b>4,42</b>                       |   | <b>51.452.788</b> | <b>19,05</b> |                   |                                   |
| <b>INDIEN</b>   |            |              |                   |                                   | <b>SUMME AKTIEN</b>   |                   |              |                   |                                   |
| HDFC BANK   | 88.672     | INR          | 1.539.381         | 0,57                              | <b>245.752.693</b>  |                   |              |                   |                                   |
| INFOSYS   | 381.130    | INR          | 6.845.740         | 2,54                              | <b>91,03</b>  |                   |              |                   |                                   |
| MINDSPACE BUSINESS PARKS  | 580.819    | INR          | 2.405.312         | 0,89                              |   |                   |              |                   |                                   |
| POWER FINANCIAL   | 762.368    | INR          | 3.567.209         | 1,32                              | <b>DEPOSITARY RECEIPTS</b>                                      |                   |              |                   |                                   |
| TECH MAHINDRA   | 138.686    | INR          | 2.075.405         | 0,77                              | <b>INDIEN</b>   |                   |              |                   |                                   |
|   |            |              | <b>16.433.047</b> | <b>6,09</b>                       | HDFC BANK   |                   |              |                   |                                   |
| <b>INDONESIEN</b>   |            |              |                   |                                   | 136.328 USD 7.607.102 2,82                                      |                   |              |                   |                                   |
| AKR CORPORINDO  | 27.333.900 | IDR          | 2.965.267         | 1,10                              | <b>SUMME DEPOSITARY RECEIPTS</b>                                |                   |              |                   |                                   |
| BANK NEGARA INDONESIA   | 7.974.600  | IDR          | 2.967.527         | 1,10                              | <b>7.607.102</b>  |                   |              |                   |                                   |
| TELEKOMUNIKASI  |            |              |                   |                                   | <b>2,82</b>   |                   |              |                   |                                   |
| INDONESIA PERSERO „B“   | 34.395.900 | IDR          | 7.527.832         | 2,79                              | <b>7.607.102</b>  |                   |              |                   |                                   |
|   |            |              | <b>13.460.626</b> | <b>4,99</b>                       | <b>2,82</b>   |                   |              |                   |                                   |
| <b>LUXEMBURG</b>  |            |              |                   |                                   | <b>VORZUGSAKTIEN</b>  |                   |              |                   |                                   |
| L'OCCITANE INTERNATIONAL  | 2.402.000  | HKD          | 9.713.638         | 3,60                              | <b>SÜDKOREA</b>   |                   |              |                   |                                   |
|   |            |              | <b>9.713.638</b>  | <b>3,60</b>                       | SAMSUNG ELECTRONICS   |                   |              |                   |                                   |
| <b>SINGAPUR</b>   |            |              |                   |                                   | 240.949 KRW 12.027.315 4,45                                     |                   |              |                   |                                   |
| DBS GROUP SINGAPUR  | 198.300    | SGD          | 5.293.975         | 1,96                              | <b>12.027.315</b>   |                   |              |                   |                                   |
| TELEKOMMUNIKATION   | 3.030.700  | SGD          | 5.681.440         | 2,10                              | <b>4,45</b>   |                   |              |                   |                                   |
|   |            |              | <b>10.975.415</b> | <b>4,06</b>                       | <b>SUMME VORZUGSAKTIEN</b>                                      |                   |              |                   |                                   |
| <b>SÜDKOREA</b>   |            |              |                   |                                   | <b>12.027.315</b>   |                   |              |                   |                                   |
| HYUNDAI MARINE & FIRE INSURANCE                                   | 343.402    | KRW          | 7.869.231         | 2,91                              | <b>4,45</b>   |                   |              |                   |                                   |
|   |            |              |                   |                                   | <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTEN WERTPAPIERE</b> |                   |              |                   |                                   |
|   |            |              |                   |                                   | <b>265.387.110</b>  |                   |              |                   |                                   |
|   |            |              |                   |                                   | <b>98,30</b>  |                   |              |                   |                                   |
|   |            |              |                   |                                   | <b>WERTPAPIERE</b>  |                   |              |                   |                                   |
|   |            |              |                   |                                   | <b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>                        |                   |              |                   |                                   |
|   |            |              |                   |                                   | <b>IRLAND</b>   |                   |              |                   |                                   |
|   |            |              |                   |                                   | HSBC GLOBAL LIQUIDITY FUND                                      |                   |              |                   |                                   |
|   |            |              |                   |                                   | 3.299.780 USD   | 3.299.780         | 1,22         |                   |                                   |
|   |            |              |                   |                                   |   | <b>3.299.780</b>  | <b>1,22</b>  |                   |                                   |
|   |            |              |                   |                                   | <b>SUMME ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>                  |                   |              |                   |                                   |
|   |            |              |                   |                                   | <b>3.299.780</b>  |                   |              |                   |                                   |
|   |            |              |                   |                                   | <b>1,22</b>   |                   |              |                   |                                   |
|   |            |              |                   |                                   | <b>SUMME WERTPAPIERANLAGEN</b>                                  |                   |              |                   |                                   |
|   |            |              |                   |                                   | <b>268.686.890</b>  |                   |              |                   |                                   |
|   |            |              |                   |                                   | <b>99,52</b>  |                   |              |                   |                                   |
|   |            |              |                   |                                   | <b>SONSTIGES NETTOVERMÖGEN</b>                                  |                   |              |                   |                                   |
|   |            |              |                   |                                   | <b>1.296.334</b>  |                   |              |                   |                                   |
|   |            |              |                   |                                   | <b>0,48</b>   |                   |              |                   |                                   |
|   |            |              |                   |                                   | <b>GESAMTNETTOVERMÖGEN</b>                                      |                   |              |                   |                                   |
|   |            |              |                   |                                   | <b>269.983.224</b>  |                   |              |                   |                                   |
|   |            |              |                   |                                   | <b>100,00</b>   |                   |              |                   |                                   |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

China A-Shares Equity  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl    | Wäh-<br>rung | Kurswert  | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens | Beschreibung  | Anzahl    | Wäh-<br>rung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |
|---|-----------|--------------|-----------|-----------------------------------|---|-----------|--------------|-------------------|-----------------------------------|
| <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>  |           |              |           |                                   |   |           |              |                   |                                   |
| <b>AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |           |              |           |                                   |   |           |              |                   |                                   |
| <b>AKTIEN</b>   |           |              |           |                                   |   |           |              |                   |                                   |
| <b>CHINA</b>  |           |              |           |                                   |   |           |              |                   |                                   |
| AGRICULTURAL BANK OF CHINA  | 977.700   | CNY          | 564.101   | 2,38                              | WANHUA CHEMICAL GROUP   | 18.100    | CNY          | 201.474           | 0,85                              |
| AIR CHINA   | 498.900   | CNY          | 503.908   | 2,12                              | WEICHAI POWER   | 366.900   | CNY          | 827.974           | 3,49                              |
| BAOSHAN IRON AND STEEL  | 261.600   | CNY          | 234.184   | 0,99                              | XCMG CONSTRUCTION MACHINERY   | 503.000   | CNY          | 432.190           | 1,82                              |
| BEIJING NEW BUILDING MATERIAL „A“                                 | 71.100    | CNY          | 281.451   | 1,19                              | YANTAI JEREH OILFIELD SERVICES  | 195.600   | CNY          | 804.327           | 3,39                              |
| BOE TECHNOLOGY GROUP  | 702.800   | CNY          | 391.879   | 1,65                              | ZHEJIANG IDC FLUID CONTROL  | 495.000   | CNY          | 575.992           | 2,43                              |
| CGN POWER   | 855.600   | CNY          | 471.160   | 1,99                              | ZIGIN MINING GROUP „A“  | 329.900   | CNY          | 734.891           | 3,10                              |
| CHINA MERCHANTS BANK „A“  | 210.600   | CNY          | 937.690   | 3,95                              | ZTE CORPORATION   | 171.100   | CNY          | 649.841           | 2,74                              |
| CHINA MERCHANTS ENERGY SHIPPING                                   | 361.500   | CNY          | 385.636   | 1,63                              |   |           |              | <b>20.963.997</b> | <b>88,41</b>                      |
| CHINA MOLYBDENUM  | 315.400   | CNY          | 356.532   | 1,50                              | <b>HONGKONG</b>   |           |              |                   |                                   |
| CHINA NATIONAL ACCORD MEDICINE                                    | 86.600    | CNY          | 361.979   | 1,53                              | CHINA MOBILE  | 33.600    | CNY          | 493.206           | 2,08                              |
| CHINA NATIONAL MEDICINES  | 84.100    | CNY          | 369.682   | 1,56                              | CNOOC   | 198.700   | CNY          | 773.912           | 3,26                              |
| CNOOC ENERGY TECHNOLOGY & SERVICES                                | 819.200   | CNY          | 386.509   | 1,63                              |   |           |              | <b>1.267.118</b>  | <b>5,34</b>                       |
| CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOLOGY                                   | 46.800    | CNY          | 1.222.410 | 5,16                              | <b>SUMME AKTIEN</b>   |           |              |                   |                                   |
| GREE ELECTRIC APPLIANCES  | 87.500    | CNY          | 474.580   | 2,00                              | <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTEN WERTPAPIERE</b>                 |           |              |                   |                                   |
| GUOTAI JUNAN SECURITIES COMPANY                                   | 270.400   | CNY          | 533.134   | 2,25                              | <b>22.231.115 93,75</b>   |           |              |                   |                                   |
| HUATAI SECURITIES   | 314.300   | CNY          | 600.990   | 2,53                              | <b>WERTPAPIERE</b>  |           |              |                   |                                   |
| HUBEI JUMPCAN PHARMACEUTICAL                                      | 102.400   | CNY          | 519.973   | 2,19                              | <b>AN EINEM ANDEREM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE, ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>    |           |              |                   |                                   |
| INDUSTRIAL BANK   | 211.200   | CNY          | 474.856   | 2,00                              | <b>AKTIEN</b>   |           |              |                   |                                   |
| INNER MONGOLIA YILI INDUSTRIAL GROUP                              | 162.200   | CNY          | 624.118   | 2,63                              | <b>CHINA</b>  |           |              |                   |                                   |
| JCET GROUP  | 148.000   | CNY          | 594.461   | 2,51                              | BANK OF JIANGSU   | 1.259.400 | CNY          | 1.366.138         | 5,76                              |
| KWEICHOU MOUTAI   | 5.200     | CNY          | 1.224.295 | 5,17                              |   |           |              | <b>1.366.138</b>  | <b>5,76</b>                       |
| LUXSHARE PRECISION INDUSTRY                                       | 315.835   | CNY          | 1.300.055 | 5,49                              | <b>SUMME AKTIEN</b>   |           |              |                   |                                   |
| MIDEA GROUP   | 82.400    | CNY          | 736.275   | 3,10                              | <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN MARKT GEHANDELTEN ÜBERTRAGBAREN WERTPAPIERE</b> |           |              |                   |                                   |
| NARI TECHNOLOGY DEVELOPMENT                                       | 50.400    | CNY          | 168.129   | 0,71                              | <b>1.366.138 5,76</b>   |           |              |                   |                                   |
| NINGBO ORIENT WIRES & CABLES                                      | 83.000    | CNY          | 506.329   | 2,14                              | <b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>  |           |              |                   |                                   |
| POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA                                      | 705.200   | CNY          | 464.445   | 1,96                              | <b>IRLAND</b>   |           |              |                   |                                   |
| SHANDONG NANSHAN ALUMINUM   | 1.365.500 | CNY          | 636.702   | 2,68                              | HSBC GLOBAL LIQUIDITY FUND  | 204.642   | USD          | 204.642           | 0,86                              |
| SHANGHAI SIYUAN ELECTRIC  | 20.100    | CNY          | 161.914   | 0,68                              |   |           |              | <b>204.642</b>    | <b>0,86</b>                       |
| SHENGYI TECHNOLOGY  | 127.700   | CNY          | 309.910   | 1,31                              | <b>SUMME ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>                                  |           |              |                   |                                   |
| TCL CORP  | 857.900   | CNY          | 553.143   | 2,33                              | <b>204.642 0,86</b>   |           |              |                   |                                   |
| TSINGTAO BREWERY 'A'  | 33.232    | CNY          | 386.878   | 1,63                              | <b>SUMME WERTPAPIERANLAGEN</b>  |           |              |                   |                                   |
|   |           |              |           |                                   | <b>23.801.895 100,37</b>  |           |              |                   |                                   |
|   |           |              |           |                                   | <b>SONSTIGE NETTOVERBINDLICHKEITEN</b>  |           |              |                   |                                   |
|   |           |              |           |                                   | <b>(86.894) -0,37</b>   |           |              |                   |                                   |
|   |           |              |           |                                   | <b>GESAMTNETTOVERMÖGEN</b>  |           |              |                   |                                   |
|   |           |              |           |                                   | <b>23.715.001 100,00</b>  |           |              |                   |                                   |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Chinesische Equity  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl     | Wäh-<br>rung | Kurswert   | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens | Beschreibung  | Anzahl     | Wäh-<br>rung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |
|---|------------|--------------|------------|-----------------------------------|---|------------|--------------|--------------------|-----------------------------------|
| <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>                              |            |              |            |                                   | <b>SHENZHEN INOVANCE</b>  |            |              |                    |                                   |
| <b>AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE</b> |            |              |            |                                   | <b>TECHNOLOGY „A“</b>   |            |              |                    |                                   |
| <b>WERTPAPIERE</b>                                    |            |              |            |                                   | <b>SUNGROW POWER SUPPLY</b>                                     |            |              |                    |                                   |
| <b>AKTIEN</b>   |            |              |            |                                   | <b>SUNNY OPTICAL</b>  |            |              |                    |                                   |
| <b>CHINA</b>  |            |              |            |                                   | <b>TECHNOLOGY GROUP</b>   |            |              |                    |                                   |
| AGRICULTURAL BANK OF CHINA                            | 28.192.500 | CNY          | 16.266.142 | 2,80                              | TENCENT HOLDINGS  | 1.485.700  | HKD          | 57.670.547         | 9,91                              |
| AGRICULTURAL BANK OF CHINA „H“                        | 28.624.000 | HKD          | 12.069.227 | 2,08                              | TRIP COM GROUP  | 358.242    | HKD          | 15.800.924         | 2,72                              |
| ALIBABA GROUP HOLDING                                 | 5.749.928  | HKD          | 51.611.195 | 8,87                              | WILL SEMICONDUCTOR „A“  | 302.700    | CNY          | 4.125.376          | 0,71                              |
| BAIDU   | 748.936    | HKD          | 9.827.665  | 1,69                              | WUXI BIOLOGICS  | 658.500    | HKD          | 1.203.170          | 0,21                              |
| BEIJING KINGSOFT OFFICE SOFTWARE                      | 34.068     | CNY          | 1.409.348  | 0,24                              | XIAOMI  | 5.618.200  | HKD          | 10.724.646         | 1,84                              |
| BYD „H“   | 102.500    | HKD          | 2.640.278  | 0,45                              | ZHEJIANG SANHUA   | 347.000    | CNY          | 1.152.754          | 0,20                              |
| CHINA COMMUNICATIONS CONSTRUCTION „H“                 | 15.496.000 | HKD          | 7.306.025  | 1,26                              | ZHEJIANG SHUANGHUAN DRIVELINE                                   | 847.504    | CNY          | 2.706.403          | 0,47                              |
| CHINA CONSTRUCTION BANK „H“                           | 55.024.480 | HKD          | 33.184.335 | 5,70                              | ZHONGJI INNOLIGHT   | 662.500    | CNY          | 14.179.569         | 2,44                              |
| CHINA CONSTRUCTIONS BANK BANK                         | 3.576.900  | CNY          | 3.380.200  | 0,58                              | ZIGIN MINING GROUP „A“  | 2.906.600  | CNY          | 6.474.795          | 1,11                              |
| CHINA MERCHANTS BANK „H“                              | 1.633.500  | HKD          | 6.459.739  | 1,11                              |   |            |              | <b>427.131.191</b> | <b>73,46</b>                      |
| CHINA MOLYBDENUM                                      | 10.080.700 | CNY          | 11.395.350 | 1,96                              | <b>HONGKONG</b>   |            |              |                    |                                   |
| CHINA RESOURCES LAND                                  | 1.343.500  | HKD          | 4.248.622  | 0,73                              | BEIGENE   | 125.005    | HKD          | 1.518.949          | 0,26                              |
| CHINA RESOURCES SANJIU MEDICAL                        | 353.700    | CNY          | 2.580.523  | 0,44                              | CHINA MOBILE  | 1.876.000  | HKD          | 16.035.929         | 2,76                              |
| CHINA TELECOM CORP „H“                                | 35.430.000 | HKD          | 18.967.948 | 3,26                              | CHINA RESOURCES ENTERPRISES                                     | 518.000    | HKD          | 2.385.999          | 0,41                              |
| CHINA YANGTZE POWER                                   | 2.250.500  | CNY          | 7.737.850  | 1,33                              | CNOOC   | 10.939.000 | HKD          | 25.326.256         | 4,36                              |
| CHINASOFT INTERNATIONAL                               | 828.000    | HKD          | 499.353    | 0,09                              |   |            |              | <b>45.267.133</b>  | <b>7,79</b>                       |
| CHINA SOFT INTERNATIONAL                              | 828.000    | HKD          | 499.353    | 0,09                              | <b>LUXEMBURG</b>  |            |              |                    |                                   |
| CITIC SECURITIES „A“                                  | 1.084.100  | CNY          | 2.896.453  | 0,50                              | SAMSONITE INTERNATIONAL   | 311.400    | HKD          | 1.177.729          | 0,20                              |
| CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOLOGY                       | 340.962    | CNY          | 8.905.881  | 1,53                              |   |            |              | <b>1.177.729</b>   | <b>0,20</b>                       |
| HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING                        | 1.364.000  | HKD          | 3.077.799  | 0,53                              | <b>TAIWAN</b>   |            |              |                    |                                   |
| INNOVENT BIOLOGICS                                    | 1.022.500  | HKD          | 4.925.381  | 0,85                              | HON HAI PRECISION INDUSTRIES                                    | 621.000    | TWD          | 3.017.342          | 0,52                              |
| JIANGSU HENGRUI MEDICINE                              | 925.807    | CNY          | 5.919.313  | 1,02                              | LARGAN PRECISION  | 26.000     | TWD          | 1.974.159          | 0,34                              |
| KUAISHOU TECHNOLOGY                                   | 898.100    | HKD          | 5.628.581  | 0,97                              | MEDIATEK  | 96.000     | TWD          | 3.479.619          | 0,60                              |
| KWEICHOU MOUTAI                                       | 96.254     | CNY          | 22.662.164 | 3,90                              | QUANTA COMPUTER   | 144.000    | TWD          | 1.259.862          | 0,22                              |
| LI AUTO   | 165.734    | HKD          | 2.568.666  | 0,44                              | TAIWAN SEMICONDUCTOR  |            |              |                    |                                   |
| LUXSHARE PRECISION INDUSTRY                           | 233.775    | CNY          | 962.277    | 0,17                              | VERARBEITENDES GEWERBE  | 1.553.000  | TWD          | 37.316.450         | 6,41                              |
| MAXSCEND MICROELECTRONICS                             | 273.780    | CNY          | 3.806.241  | 0,65                              |   |            |              | <b>47.047.432</b>  | <b>8,09</b>                       |
| MEITUAN DIANPING                                      | 303.470    | HKD          | 3.753.413  | 0,65                              | <b>SUMME AKTIEN</b>   |            |              |                    |                                   |
| MIDEA GROUP   | 611.078    | CNY          | 5.460.213  | 0,94                              |   |            |              | <b>520.623.485</b> | <b>89,54</b>                      |
| NAURA TECHNOLOGY GROUP                                | 138.800    | CNY          | 5.889.847  | 1,01                              | <b>DEPOSITARY RECEIPTS</b>                                      |            |              |                    |                                   |
| NETEASE   | 1.304.115  | HKD          | 27.127.231 | 4,67                              | <b>CHINA</b>  |            |              |                    |                                   |
| PING AN INSURANCE                                     | 214.000    | CNY          | 1.204.804  | 0,21                              | HUAZHU GROUP  | 72.781     | USD          | 2.809.347          | 0,48                              |
| PING AN INSURANCE „H“                                 | 1.361.500  | HKD          | 5.749.423  | 0,99                              | PINDUODUO   | 226.022    | USD          | 26.374.507         | 4,54                              |
| SHANGHAI SIYUAN ELECTRIC                              | 294.400    | CNY          | 2.371.510  | 0,41                              | TAL EDUCATION GROUP   | 494.514    | USD          | 5.677.021          | 0,98                              |
| SHENZHEN ENVICOOOL TECHNOLOGY                         | 265.300    | CNY          | 1.118.838  | 0,19                              | TENCENT MUSIC ENTERTAINMENT GROUP                               | 164.569    | USD          | 1.857.984          | 0,32                              |
|   |            |              |            |                                   |   |            |              | <b>36.718.859</b>  | <b>6,32</b>                       |
|   |            |              |            |                                   | <b>SUMME DEPOSITARY RECEIPTS</b>                                |            |              |                    |                                   |
|   |            |              |            |                                   | <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTEN WERTPAPIERE</b> |            |              |                    |                                   |
|   |            |              |            |                                   |   |            |              | <b>36.718.859</b>  | <b>6,32</b>                       |
|   |            |              |            |                                   |   |            |              | <b>557.342.344</b> | <b>95,86</b>                      |
|   |            |              |            |                                   | <b>WERTPAPIERE</b>  |            |              |                    |                                   |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Chinese Equity (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl    | Wäh-<br>rung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |
|---|-----------|--------------|--------------------|-----------------------------------|
| <b>AN EINEM ANDEREM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE, ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>        |           |              |                    |                                   |
| <b>AKTIEN</b>   |           |              |                    |                                   |
| <b>CHINA</b>  |           |              |                    |                                   |
| NEW ORIENTAL EDUCATION<br>AND TECHNOLOGY  | 2.161.700 | HKD          | 18.823.331         | 3,24                              |
|   |           |              | <b>18.823.331</b>  | <b>3,24</b>                       |
| <b>SUMME AKTIEN</b>   |           |              | <b>18.823.331</b>  | <b>3,24</b>                       |
| <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN<br/>MARKT GEHANDELTEN ÜBERTRAGBAREN WERTPAPIERE</b> |           |              | <b>18.823.331</b>  | <b>3,24</b>                       |
| <b>SUMME WERTPAPIERANLAGEN</b>  |           |              | <b>576.165.675</b> | <b>99,10</b>                      |
| <b>SONSTIGES NETTOVERMÖGEN</b>  |           |              | <b>5.249.074</b>   | <b>0,90</b>                       |
| <b>GESAMTNETTOVERMÖGEN</b>  |           |              | <b>581.414.749</b> | <b>100,00</b>                     |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Euroland Equity Smaller Companies  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in EUR)

| Beschreibung  | Anzahl  | Wäh-<br>rung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens | Beschreibung   | Anzahl  | Wäh-<br>rung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |
|---|---------|--------------|-------------------|-----------------------------------|--|---------|--------------|-------------------|-----------------------------------|
| <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>  |         |              |                   |                                   | <b>IRLAND</b>  |         |              |                   |                                   |
| <b>AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |         |              |                   |                                   | KINGSPAN GROUP 38.546 EUR 3.277.181 3,16                                     |         |              |                   |                                   |
| <b>AKTIEN</b>   |         |              |                   |                                   | SMURFIT KAPPA 36.661 EUR 1.552.960 1,50                                      |         |              |                   |                                   |
|   |         |              |                   |                                   | <b>4.830.141 4,66</b>  |         |              |                   |                                   |
| <b>ÖSTERREICH</b>   |         |              |                   |                                   | <b>ITALIEN</b>   |         |              |                   |                                   |
| ANDRITZ   | 26.180  | EUR          | 1.506.659         | 1,45                              | DAVIDE CAMPARI-MILANO  | 99.900  | EUR          | 929.070           | 0,90                              |
| BAWAG GROUP   | 39.243  | EUR          | 2.307.488         | 2,23                              | DE LONGHI  | 28.581  | EUR          | 920.880           | 0,89                              |
|   |         |              | <b>3.814.147</b>  | <b>3,68</b>                       | DIASORIN   | 15.983  | EUR          | 1.430.798         | 1,38                              |
| <b>BELGIEN</b>  |         |              |                   |                                   | ERG 35.252 EUR 819.962 0,79  |         |              |                   |                                   |
| AGEAS   | 51.908  | EUR          | 2.228.411         | 2,15                              | FINCOBANK BANCA FINECO   | 220.885 | EUR          | 3.064.778         | 2,95                              |
| KINEPOLIS GROUP   | 20.805  | EUR          | 883.172           | 0,85                              | NEXI   | 46.410  | EUR          | 270.756           | 0,26                              |
|   |         |              | <b>3.111.583</b>  | <b>3,00</b>                       | RAI WAY  | 350.095 | EUR          | 1.816.993         | 1,75                              |
| <b>FINNLAND</b>   |         |              |                   |                                   | REPLY 8.811 EUR 1.159.528 1,12   |         |              |                   |                                   |
| KESKO UYJ „B“   | 127.038 | EUR          | 2.199.028         | 2,12                              |  |         |              | <b>10.412.765</b> | <b>10,04</b>                      |
| OUTOTEC   | 245.035 | EUR          | 2.689.259         | 2,59                              | <b>LUXEMBURG</b>   |         |              |                   |                                   |
| UPM-KYMMENE   | 61.100  | EUR          | 1.884.324         | 1,82                              | APERAM   | 52.614  | EUR          | 1.539.486         | 1,48                              |
|   |         |              | <b>6.772.611</b>  | <b>6,53</b>                       | BEFESA   | 25.930  | EUR          | 825.093           | 0,80                              |
| <b>FRANKREICH</b>   |         |              |                   |                                   | TENARIS 167.000 EUR 3.056.934 2,95   |         |              |                   |                                   |
| COFACE  | 77.390  | EUR          | 1.132.216         | 1,09                              |  |         |              | <b>5.421.513</b>  | <b>5,23</b>                       |
| EDENRED   | 37.505  | EUR          | 1.861.373         | 1,79                              | <b>NIEDERLANDE</b>   |         |              |                   |                                   |
| EUROFINS SCIENTIFIC   | 53.691  | EUR          | 3.165.621         | 3,06                              | ARCADIS  | 7.000   | EUR          | 397.600           | 0,38                              |
| GAZTRANSPORT ET   |         |              |                   |                                   | ASM INTERNATIONAL  | 7.250   | EUR          | 4.119.450         | 3,98                              |
| TECHNIGAZ   | 11.177  | EUR          | 1.556.956         | 1,50                              | EURONEXT   | 40.818  | EUR          | 3.594.025         | 3,46                              |
| GROUPE OTUNNEL  | 72.300  | EUR          | 1.142.702         | 1,10                              | IVECO GROUP  | 93.600  | EUR          | 1.296.360         | 1,25                              |
| IMERYS  | 22.500  | EUR          | 706.050           | 0,68                              | TECHNIP ENERGIES   | 52.800  | EUR          | 1.228.656         | 1,18                              |
| IPSOS   | 6.437   | EUR          | 420.980           | 0,41                              | TKH GROUP  | 29.368  | EUR          | 1.160.036         | 1,12                              |
| NEXANS  | 22.817  | EUR          | 2.202.981         | 2,12                              |  |         |              | <b>11.796.127</b> | <b>11,37</b>                      |
| NEXITY  | 38.641  | EUR          | 363.805           | 0,35                              | <b>SPANIEN</b>   |         |              |                   |                                   |
| PLASTIC OMNIUM  | 119.795 | EUR          | 1.444.728         | 1,39                              | CORP ACCIONA ENERGIAS  |         |              |                   |                                   |
| PLUXEE FRANCE   | 25.300  | EUR          | 693.473           | 0,67                              | RENOVABLES   | 66.993  | EUR          | 1.346.559         | 1,30                              |
| PUBLICIS GROUPE   | 30.400  | EUR          | 3.073.440         | 2,96                              |  |         |              | <b>1.346.559</b>  | <b>1,30</b>                       |
| SODEXO  | 27.500  | EUR          | 2.190.650         | 2,11                              | <b>SUMME AKTIEN</b>  |         |              |                   |                                   |
| UNIBAIL-RODAMCO-  |         |              |                   |                                   |  |         |              | <b>87.926.014</b> | <b>84,77</b>                      |
| WESTFIELD   | 23.700  | EUR          | 1.765.176         | 1,70                              | <b>VORZUGSAKTIEN</b>   |         |              |                   |                                   |
|   |         |              | <b>21.720.151</b> | <b>20,93</b>                      | <b>DEUTSCHLAND</b>   |         |              |                   |                                   |
| <b>DEUTSCHLAND</b>  |         |              |                   |                                   | SIXT 13.200 EUR 896.280 0,86   |         |              |                   |                                   |
| BECHTLE   | 39.642  | EUR          | 1.934.530         | 1,87                              |  |         |              | <b>896.280</b>    | <b>0,86</b>                       |
| BRENTAG   | 40.255  | EUR          | 3.144.721         | 3,03                              | <b>SUMME VORZUGSAKTIEN</b>   |         |              |                   |                                   |
| COMMERZBANK   | 174.637 | EUR          | 2.216.144         | 2,14                              |  |         |              | <b>896.280</b>    | <b>0,86</b>                       |
| ENCAVIS   | 18.609  | EUR          | 313.655           | 0,30                              | <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTEN WERTPAPIERE</b>              |         |              |                   |                                   |
| GERRESHEIMER  | 13.700  | EUR          | 1.423.430         | 1,37                              |  |         |              | <b>88.822.294</b> | <b>85,63</b>                      |
| HUGO BOSS   | 28.500  | EUR          | 1.563.510         | 1,51                              | <b>WERTPAPIERE</b>   |         |              |                   |                                   |
| PUMA  | 22.100  | EUR          | 925.769           | 0,89                              | <b>AN EINEM ANDEREM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE, ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |         |              |                   |                                   |
| STABILUS  | 19.700  | EUR          | 1.166.240         | 1,12                              | <b>AKTIEN</b>  |         |              |                   |                                   |
| STROEER   | 28.245  | EUR          | 1.595.843         | 1,54                              | <b>ÖSTERREICH</b>  |         |              |                   |                                   |
| SYMRISE   | 35.521  | EUR          | 3.951.710         | 3,81                              | WIENERBERGER   | 70.416  | EUR          | 2.381.469         | 2,30                              |
|   |         |              | <b>18.235.552</b> | <b>17,58</b>                      |  |         |              | <b>2.381.469</b>  | <b>2,30</b>                       |
| <b>GROSSBRITANNIEN</b>  |         |              |                   |                                   |  |         |              |                   |                                   |
| ALLFUNDS GROUP  | 69.852  | EUR          | 464.865           | 0,45                              |  |         |              |                   |                                   |
|   |         |              | <b>464.865</b>    | <b>0,45</b>                       |  |         |              |                   |                                   |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Euroland Equity Smaller Companies (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in EUR)

| Beschreibung  | Anzahl  | Wäh-<br>rung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |
|---|---------|--------------|--------------------|-----------------------------------|
| <b>FINNLAND</b>   |         |              |                    |                                   |
| KCI KONECRANES  | 35.998  | EUR          | 1.726.464          | 1,66                              |
|   |         |              | <b>1.726.464</b>   | <b>1,66</b>                       |
| <b>FRANKREICH</b>   |         |              |                    |                                   |
| SPIE  | 78.540  | EUR          | 2.737.905          | 2,64                              |
| SR TELEPERFORMANCE  | 11.557  | EUR          | 1.040.592          | 1,00                              |
|   |         |              | <b>3.778.497</b>   | <b>3,64</b>                       |
| <b>NIEDERLANDE</b>  |         |              |                    |                                   |
| ASR NEDERLAND   | 39.738  | EUR          | 1.801.324          | 1,74                              |
| CTP   | 119.556 | EUR          | 1.967.891          | 1,90                              |
|   |         |              | <b>3.769.215</b>   | <b>3,64</b>                       |
| <b>SUMME AKTIEN</b>   |         |              | <b>11.655.645</b>  | <b>11,24</b>                      |
| <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN<br/>MARKT GEHANDELTEN ÜBERTRAGBAREN WERTPAPIERE</b> |         |              | <b>11.655.645</b>  | <b>11,24</b>                      |
| <b>SUMME WERTPAPIERANLAGEN</b>  |         |              | <b>100.477.939</b> | <b>96,87</b>                      |
| <b>SONSTIGES NETTOVERMÖGEN</b>  |         |              | <b>3.248.105</b>   | <b>3,13</b>                       |
| <b>GESAMTNETTOVERMÖGEN</b>  |         |              | <b>103.726.044</b> | <b>100,00</b>                     |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.





# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Euroland Value  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in EUR)

| Beschreibung  | Anzahl  | Wäh-<br>rung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens | Beschreibung  | Anzahl    | Wäh-<br>rung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |
|---|---------|--------------|-------------------|-----------------------------------|---|-----------|--------------|--------------------|-----------------------------------|
| <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>  |         |              |                   |                                   | <b>ITALIEN</b>  |           |              |                    |                                   |
| <b>AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |         |              |                   |                                   | <b>POSTE ITALIANE</b>   |           |              |                    |                                   |
| <b>AKTIEN</b>   |         |              |                   |                                   | <b>PRYSMIAN</b>   |           |              |                    |                                   |
| <b>ÖSTERREICH</b>   |         |              |                   |                                   |   |           |              |                    |                                   |
| ERSTE BANK  | 139.217 | EUR          | 5.734.348         | 2,28                              |   | 503.670   | EUR          | 5.832.499          | 2,31                              |
| OMV   | 135.145 | EUR          | 5.893.674         | 2,34                              |   | 71.070    | EUR          | 3.441.209          | 1,37                              |
|   |         |              | <b>11.628.022</b> | <b>4,62</b>                       |   |           |              | <b>9.273.708</b>   | <b>3,68</b>                       |
| <b>BELGIEN</b>  |         |              |                   |                                   | <b>LUXEMBURG</b>  |           |              |                    |                                   |
| SYENSQO   | 40.495  | EUR          | 3.544.122         | 1,41                              | ARCELORMITTAL   | 118.348   | EUR          | 3.011.365          | 1,20                              |
|   |         |              | <b>3.544.122</b>  | <b>1,41</b>                       |   |           |              | <b>3.011.365</b>   | <b>1,20</b>                       |
| <b>FINNLAND</b>   |         |              |                   |                                   | <b>NIEDERLANDE</b>  |           |              |                    |                                   |
| OUTOTEC   | 601.352 | EUR          | 6.599.838         | 2,62                              | AHOLD DELHAIZE  | 246.166   | EUR          | 6.815.106          | 2,71                              |
|   |         |              | <b>6.599.838</b>  | <b>2,62</b>                       | HEINEKEN  | 52.123    | EUR          | 4.658.754          | 1,85                              |
| <b>FRANKREICH</b>   |         |              |                   |                                   | ING GROEP   |           |              |                    |                                   |
| ALSTOM  | 116.686 | EUR          | 1.648.190         | 0,65                              | KONINKLIJKE KPN   | 2.002.887 | EUR          | 6.946.012          | 2,76                              |
| ARKEMA  | 24.160  | EUR          | 2.364.298         | 0,94                              | PHILIPS LIGHTING  | 66.061    | EUR          | 1.896.611          | 0,75                              |
| AXA   | 251.866 | EUR          | 8.764.937         | 3,48                              | STELLANTIS  | 203.862   | EUR          | 5.365.648          | 2,13                              |
| CAP GEMINI  | 26.119  | EUR          | 5.568.571         | 2,21                              |   |           |              | <b>33.036.970</b>  | <b>13,11</b>                      |
| CARREFOUR   | 268.315 | EUR          | 4.248.768         | 1,69                              | <b>PORTUGAL</b>   |           |              |                    |                                   |
| CREDIT AGRICOLE   | 276.214 | EUR          | 3.822.249         | 1,52                              | GALP ENERGIA „B“  | 386.695   | EUR          | 5.912.567          | 2,35                              |
| ELIS  | 180.046 | EUR          | 3.784.567         | 1,50                              |   |           |              | <b>5.912.567</b>   | <b>2,35</b>                       |
| FAURECIA  | 78.652  | EUR          | 1.107.420         | 0,44                              | <b>SPANIEN</b>  |           |              |                    |                                   |
| GDF SUEZ  | 374.841 | EUR          | 5.801.789         | 2,30                              | ACTIV DE CONSTR Y SERVICE   | 161.904   | EUR          | 6.285.113          | 2,49                              |
| MICHELIN  | 206.657 | EUR          | 7.342.523         | 2,91                              | BANCO SANTANDER   | 1.158.269 | EUR          | 5.237.113          | 2,08                              |
| PUBLICIS GROUPE   | 55.940  | EUR          | 5.655.534         | 2,24                              | GRIFOLS „B“   | 347.325   | EUR          | 2.082.213          | 0,83                              |
| SAINT GOBAIN  | 58.180  | EUR          | 4.178.488         | 1,66                              | IBERDROLA   | 779.631   | EUR          | 8.969.655          | 3,55                              |
| SANOFI  | 60.730  | EUR          | 5.528.859         | 2,19                              | REPSOL  | 113.804   | EUR          | 1.754.289          | 0,70                              |
| SEB   | 22.528  | EUR          | 2.680.832         | 1,06                              | TELEFONICA  | 280.662   | EUR          | 1.149.030          | 0,46                              |
| SOCIETE GENERALE  | 219.052 | EUR          | 5.404.013         | 2,15                              |   |           |              | <b>25.477.413</b>  | <b>10,11</b>                      |
| THALES  | 29.924  | EUR          | 4.738.465         | 1,88                              | <b>SUMME AKTIEN</b>   |           |              | <b>236.408.859</b> | <b>93,84</b>                      |
| TOTAL   | 146.753 | EUR          | 9.320.283         | 3,71                              | <b>VORZUGSAKTIEN</b>  |           |              |                    |                                   |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT  | 102.260 | EUR          | 3.079.049         | 1,22                              | <b>DEUTSCHLAND</b>  |           |              |                    |                                   |
|   |         |              | <b>85.038.835</b> | <b>33,75</b>                      | HENKEL  | 26.845    | EUR          | 2.005.858          | 0,80                              |
| <b>DEUTSCHLAND</b>  |         |              |                   |                                   |   |           |              | <b>2.005.858</b>   | <b>0,80</b>                       |
| ALLIANZ   | 41.604  | EUR          | 11.551.350        | 4,58                              | <b>SUMME VORZUGSAKTIEN</b>  |           |              | <b>2.005.858</b>   | <b>0,80</b>                       |
| DEUTSCHE ANNINGTON  |         |              |                   |                                   | <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTEN WERTPAPIERE</b>                 |           |              |                    |                                   |
| IMMOBILIEN  | 144.204 | EUR          | 3.932.443         | 1,56                              |   |           |              | <b>238.414.717</b> | <b>94,64</b>                      |
| DEUTSCHE POST   | 71.212  | EUR          | 2.843.139         | 1,13                              | <b>WERTPAPIERE</b>  |           |              |                    |                                   |
| DEUTSCHE TELEKOM  | 215.355 | EUR          | 4.853.025         | 1,93                              | <b>AN EINEM ANDEREM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE, ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>    |           |              |                    |                                   |
| FRESENIUS   | 112.755 | EUR          | 2.818.875         | 1,12                              | <b>AKTIEN</b>   |           |              |                    |                                   |
| MERCK KGAA  | 43.376  | EUR          | 7.104.989         | 2,81                              | <b>FRANKREICH</b>   |           |              |                    |                                   |
| SIEMENS   | 38.272  | EUR          | 6.766.490         | 2,69                              | SR TELEPERFORMANCE  | 15.923    | EUR          | 1.433.707          | 0,57                              |
|   |         |              | <b>39.870.311</b> | <b>15,82</b>                      |   |           |              | <b>1.433.707</b>   | <b>0,57</b>                       |
| <b>GROSSBRITANNIEN</b>  |         |              |                   |                                   | <b>ITALIEN</b>  |           |              |                    |                                   |
| REED ELSEVIER   | 151.474 | EUR          | 6.089.255         | 2,42                              | UNICREDIT   | 204.154   | EUR          | 7.194.387          | 2,85                              |
|   |         |              | <b>6.089.255</b>  | <b>2,42</b>                       |   |           |              | <b>7.194.387</b>   | <b>2,85</b>                       |
| <b>IRLAND</b>   |         |              |                   |                                   | <b>SUMME AKTIEN</b>   |           |              |                    |                                   |
| CRH   | 86.448  | GBP          | 6.926.453         | 2,75                              | <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN MARKT GEHANDELTEN ÜBERTRAGBAREN WERTPAPIERE</b> |           |              | <b>8.628.094</b>   | <b>3,42</b>                       |
|   |         |              | <b>6.926.453</b>  | <b>2,75</b>                       | <b>SUMME WERTPAPIERANLAGEN</b>  |           |              | <b>247.042.811</b> | <b>98,06</b>                      |
|   |         |              |                   |                                   | <b>SONSTIGES NETTOVERMÖGEN</b>  |           |              |                    |                                   |
|   |         |              |                   |                                   | <b>GESAMTNETTOVERMÖGEN</b>  |           |              |                    |                                   |
|   |         |              |                   |                                   | <b>4.884.194</b>  |           |              |                    |                                   |
|   |         |              |                   |                                   | <b>1,94</b>   |           |              |                    |                                   |
|   |         |              |                   |                                   | <b>251.927.005</b>  |           |              |                    |                                   |
|   |         |              |                   |                                   | <b>100,00</b>   |           |              |                    |                                   |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Europe Value  
Aufstellung der Wertpapiieranlagen zum 31. März 2024  
(in EUR)

| Beschreibung  | Anzahl  | Wäh-<br>rung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens | Beschreibung   | Anzahl  | Wäh-<br>rung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |
|---|---------|--------------|-------------------|-----------------------------------|--|---------|--------------|-------------------|-----------------------------------|
| <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>  |         |              |                   |                                   |  |         |              |                   |                                   |
| <b>AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |         |              |                   |                                   |  |         |              |                   |                                   |
| <b>AKTIEN</b>   |         |              |                   |                                   |  |         |              |                   |                                   |
| <b>ÖSTERREICH</b>   |         |              |                   |                                   |  |         |              |                   |                                   |
| ERSTE BANK  | 21.545  | EUR          | 887.439           | 1,44                              | BP   | 350.256 | GBP          | 2.033.681         | 3,30                              |
| OMV   | 29.634  | EUR          | 1.292.338         | 2,09                              | CRODA INTERNATIONAL  | 18.049  | GBP          | 1.035.940         | 1,68                              |
|   |         |              | <b>2.179.777</b>  | <b>3,53</b>                       | INFORMA  | 91.313  | GBP          | 891.621           | 1,44                              |
| <b>BELGIEN</b>  |         |              |                   |                                   |  |         |              |                   |                                   |
| KBC GROUP   | 34.175  | EUR          | 2.366.277         | 3,84                              | PRUDENTIAL   | 115.519 | GBP          | 999.886           | 1,62                              |
| SYENSCO   | 8.408   | EUR          | 735.868           | 1,19                              | RECKITT BENCKISER  | 34.680  | GBP          | 1.833.914         | 2,97                              |
|   |         |              | <b>3.102.145</b>  | <b>5,03</b>                       | REED ELSEVIER  | 18.698  | EUR          | 751.660           | 1,22                              |
| <b>DÄNEMARK</b>   |         |              |                   |                                   |  |         |              |                   |                                   |
| NOVO NORDISK  | 15.719  | DKK          | 1.857.235         | 3,01                              | RIO TINTO  | 15.963  | GBP          | 935.817           | 1,52                              |
|   |         |              | <b>1.857.235</b>  | <b>3,01</b>                       | SSE  | 34.460  | GBP          | 665.472           | 1,08                              |
| <b>FRANKREICH</b>   |         |              |                   |                                   |  |         |              |                   |                                   |
| AIR LIQUIDE   | 3.720   | EUR          | 717.067           | 1,16                              | WHITBREAD  | 17.255  | GBP          | 674.104           | 1,09                              |
| AXA   | 43.769  | EUR          | 1.523.161         | 2,46                              |  |         |              | <b>14.767.294</b> | <b>23,93</b>                      |
| CAP GEMINI  | 4.784   | EUR          | 1.019.949         | 1,65                              | <b>IRLAND</b>  |         |              |                   |                                   |
| GDF SUEZ  | 50.459  | EUR          | 781.004           | 1,27                              | BANK OF IRELAND GROUP  | 80.736  | EUR          | 763.601           | 1,24                              |
| GROUPE OTUNNEL  | 55.730  | EUR          | 880.813           | 1,43                              | CRH  | 8.527   | GBP          | 683.207           | 1,11                              |
| REMY COINTREAU  | 9.396   | EUR          | 876.083           | 1,42                              | SMURFIT KAPPA  | 20.785  | EUR          | 880.453           | 1,42                              |
| SAINT GOBAIN  | 11.719  | EUR          | 841.659           | 1,36                              |  |         |              | <b>2.327.261</b>  | <b>3,77</b>                       |
| SEB   | 7.461   | EUR          | 887.859           | 1,44                              | <b>ITALIEN</b>   |         |              |                   |                                   |
| THALES  | 5.794   | EUR          | 917.480           | 1,49                              | ENEL   | 149.901 | EUR          | 917.244           | 1,49                              |
| TOTAL   | 20.457  | EUR          | 1.299.224         | 2,11                              |  |         |              | <b>917.244</b>    | <b>1,49</b>                       |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT  | 22.111  | EUR          | 665.762           | 1,08                              | <b>JERSEY</b>  |         |              |                   |                                   |
| VERALLIA SASU   | 22.146  | EUR          | 797.699           | 1,29                              | FERGUSON NEWCO   | 3.058   | GBP          | 621.481           | 1,01                              |
|   |         |              | <b>11.207.760</b> | <b>18,16</b>                      |  |         |              | <b>621.481</b>    | <b>1,01</b>                       |
| <b>DEUTSCHLAND</b>  |         |              |                   |                                   | <b>NIEDERLANDE</b>   |         |              |                   |                                   |
| ALLIANZ   | 6.365   | EUR          | 1.767.242         | 2,86                              | HEINEKEN   | 18.951  | EUR          | 1.693.840         | 2,74                              |
| BMW   | 8.636   | EUR          | 923.016           | 1,50                              | ING GROEP  | 148.377 | EUR          | 2.261.266         | 3,67                              |
| COMMERZBANK   | 156.384 | EUR          | 1.984.512         | 3,21                              | KONINKLIJKE KPN  | 505.835 | EUR          | 1.754.236         | 2,85                              |
| DEUTSCHE ANNINGTON  |         |              |                   |                                   | ST MICROELECTRONICS  | 17.942  | EUR          | 718.846           | 1,16                              |
| IMMOBILIEN  | 34.727  | EUR          | 947.005           | 1,53                              |  |         |              | <b>6.428.188</b>  | <b>10,42</b>                      |
| DEUTSCHE POST   | 19.871  | EUR          | 793.350           | 1,29                              | <b>SPANIEN</b>   |         |              |                   |                                   |
| DEUTSCHE TELEKOM  | 47.349  | EUR          | 1.067.010         | 1,73                              | ACTIV DE CONSTR Y SERVICE  | 15.779  | EUR          | 612.541           | 0,99                              |
| SAP   | 4.909   | EUR          | 888.038           | 1,44                              | GRIFOLS „A“  | 103.739 | EUR          | 862.278           | 1,40                              |
| SIEMENS   | 7.302   | EUR          | 1.290.994         | 2,09                              | INDUSTRIA DE DISENO  |         |              |                   |                                   |
| THYSSENKRUPP NUCERA AG  |         |              |                   |                                   | TEXTIL   | 12.990  | EUR          | 604.685           | 0,98                              |
| & CO  | 47.892  | EUR          | 682.461           | 1,11                              |  |         |              | <b>2.079.504</b>  | <b>3,37</b>                       |
|   |         |              | <b>10.343.628</b> | <b>16,76</b>                      | <b>SCHWEIZ</b>   |         |              |                   |                                   |
| <b>GROSSBRITANNIEN</b>  |         |              |                   |                                   |  |         |              |                   |                                   |
| ANGLO AMERICAN  | 47.466  | GBP          | 1.083.081         | 1,76                              | NOVARTIS   | 16.263  | CHF          | 1.459.189         | 2,37                              |
| ASTRAZENECA   | 17.620  | GBP          | 2.206.970         | 3,57                              | UBS GROUP  | 43.686  | CHF          | 1.242.197         | 2,01                              |
| BARCLAYS  | 769.550 | GBP          | 1.655.148         | 2,68                              |  |         |              | <b>2.701.386</b>  | <b>4,38</b>                       |
|   |         |              |                   |                                   | <b>SUMME AKTIEN</b>  |         |              |                   |                                   |
|   |         |              |                   |                                   | <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN</b>                              |         |              |                   |                                   |
|   |         |              |                   |                                   | <b>BÖRSE NOTIERTEN WERTPAPIERE</b>                               |         |              |                   |                                   |
|   |         |              |                   |                                   | <b>WERTPAPIERE</b>   |         |              |                   |                                   |
|   |         |              |                   |                                   | <b>AN EINEM ANDEREM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE, ÜBERTRAGBARE</b> |         |              |                   |                                   |
|   |         |              |                   |                                   | <b>WERTPAPIERE</b>   |         |              |                   |                                   |
|   |         |              |                   |                                   | <b>AKTIEN</b>  |         |              |                   |                                   |
|   |         |              |                   |                                   | <b>BELGIEN</b>   |         |              |                   |                                   |
|   |         |              |                   |                                   | ANHEUSER BUSCH INBEV   | 28.209  | EUR          | 1.589.577         | 2,57                              |
|   |         |              |                   |                                   |  |         |              | <b>1.589.577</b>  | <b>2,57</b>                       |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Europe Value (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in EUR)

| Beschreibung  | Anzahl | Wäh-<br>rung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |
|---|--------|--------------|-------------------|-----------------------------------|
| <b>FRANKREICH</b>   |        |              |                   |                                   |
| SR TELEPERFORMANCE  | 7.325  | EUR          | 659.543           | 1,07                              |
|   |        |              | <b>659.543</b>    | <b>1,07</b>                       |
| <b>SUMME AKTIEN</b>   |        |              | <b>2.249.120</b>  | <b>3,64</b>                       |
| <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN<br/>MARKT GEHANDELTEN ÜBERTRAGBAREN WERTPAPIERE</b> |        |              | <b>2.249.120</b>  | <b>3,64</b>                       |
| <b>SUMME WERTPAPIERANLAGEN</b>  |        |              | <b>60.782.023</b> | <b>98,50</b>                      |
| <b>SONSTIGES NETTOVERMÖGEN</b>  |        |              | <b>924.687</b>    | <b>1,50</b>                       |
| <b>GESAMTNETTOVERMÖGEN</b>  |        |              | <b>61.706.710</b> | <b>100,00</b>                     |

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Emerging Markets Equity  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl     | Wäh-<br>rung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens | Beschreibung  | Anzahl | Wäh-<br>rung | Kurswert | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |
|---|------------|--------------|-------------------|-----------------------------------|---|--------|--------------|----------|-----------------------------------|
| <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>  |            |              |                   |                                   | <b>MEXIKO</b>   |        |              |          |                                   |
| <b>AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |            |              |                   |                                   | GRUPO FINANCIERO  |        |              |          |                                   |
| <b>AKTIEN</b>   |            |              |                   |                                   | BANORTE „O“   |        |              |          |                                   |
| <b>BRASILIEN</b>  |            |              |                   |                                   | 615.900 MXN 6.535.189 1,78                                      |        |              |          |                                   |
| B3 SA BRASIL BOLSA  |            |              |                   |                                   | <b>6.535.189 1,78</b>   |        |              |          |                                   |
| BALCAO  | 2.036.100  | BRL          | 4.885.290         | 1,33                              | <b>SAUDI-ARABIEN</b>  |        |              |          |                                   |
| TOTVS   | 880.200    | BRL          | 4.990.475         | 1,35                              | TADAWUL   |        |              |          |                                   |
|   |            |              | <b>9.875.765</b>  | <b>2,68</b>                       | 108.421 SAR 7.886.215 2,14                                      |        |              |          |                                   |
| <b>CHINA</b>  |            |              |                   |                                   | <b>7.886.215 2,14</b>   |        |              |          |                                   |
| ALIBABA GROUP HOLDING   | 1.561.216  | HKD          | 14.013.432        | 3,81                              | <b>SÜDAFRIKA</b>  |        |              |          |                                   |
| BAIDU   | 365.394    | HKD          | 4.794.762         | 1,30                              | MTN GROUP   |        |              |          |                                   |
| BYD „H“   | 153.500    | HKD          | 3.953.977         | 1,07                              | 1.239.499 ZAR 6.135.884 1,67                                    |        |              |          |                                   |
| CHINA LONGYUAN POWER „H“  | 11.074.000 | HKD          | 7.753.901         | 2,11                              | <b>6.135.884 1,67</b>   |        |              |          |                                   |
| CIMC ENRIC HOLDING  | 7.296.000  | HKD          | 7.420.498         | 2,02                              | <b>SÜDKOREA</b>   |        |              |          |                                   |
| CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOLOGY                                   | 334.940    | CNY          | 8.748.587         | 2,38                              | HYUNDAI MOTOR   |        |              |          |                                   |
| MEITUAN DIANPING  | 879.120    | HKD          | 10.873.233        | 2,95                              | 58.265 KRW 10.257.237 2,79                                      |        |              |          |                                   |
| PING AN INSURANCE „H“   | 873.500    | HKD          | 3.688.668         | 1,00                              | 41.725 KRW 2.178.843 0,59                                       |        |              |          |                                   |
| SHENZHEN MINDRAY BIO MEDICAL ELECTRONICS                          | 158.946    | CNY          | 6.155.338         | 1,67                              | 80.286 KRW 6.679.318 1,81                                       |        |              |          |                                   |
| TENCENT HOLDINGS  | 342.400    | HKD          | 13.290.971        | 3,61                              | 408.488 KRW 24.516.866 6,66                                     |        |              |          |                                   |
| WEICHAI POWER „H“   | 4.503.000  | HKD          | 8.584.321         | 2,33                              | 67.938 KRW 8.992.796 2,44                                       |        |              |          |                                   |
| WUXI XDC CAYMAN   | 500        | HKD          | 1.169             | 0,00                              | <b>52.625.060 14,29</b>   |        |              |          |                                   |
|   |            |              | <b>89.278.857</b> | <b>24,25</b>                      | <b>TAIWAN</b>   |        |              |          |                                   |
| <b>GROSSBRITANNIEN</b>  |            |              |                   |                                   | HON HAI PRECISION INDUSTRIES                                    |        |              |          |                                   |
| AIRTEL AFRICA   | 4.673.895  | GBP          | 6.246.747         | 1,70                              | 2.763.000 TWD 13.424.985 3,65                                   |        |              |          |                                   |
| ANGLO AMERICAN  | 310.214    | ZAR          | 7.620.260         | 2,07                              | 84.000 TWD 6.378.052 1,73                                       |        |              |          |                                   |
| XINYI SOLAR HOLDINGS  | 9.867.839  | HKD          | 7.640.642         | 2,08                              | 308.000 TWD 11.163.779 3,03                                     |        |              |          |                                   |
|   |            |              | <b>21.507.649</b> | <b>5,85</b>                       | TAIWAN SEMICONDUCTOR  |        |              |          |                                   |
| <b>INDIEN</b>   |            |              |                   |                                   | VERARBEITENDES GEWERBE  |        |              |          |                                   |
| BANDHAN BANK  | 2.479.131  | INR          | 5.350.482         | 1,45                              | 1.452.000 TWD 34.889.559 9,48                                   |        |              |          |                                   |
| HINDUSTAN UNILEVER  | 190.814    | INR          | 5.180.536         | 1,41                              | 658.000 TWD 3.906.448 1,06                                      |        |              |          |                                   |
| ICICI BANK  | 279.310    | INR          | 3.661.397         | 0,99                              | <b>69.762.823 18,95</b>   |        |              |          |                                   |
| INFOSYS   | 316.233    | INR          | 5.680.080         | 1,54                              | <b>TÜRKEI</b>   |        |              |          |                                   |
| RELIANCE INDUSTRIES   | 497.916    | INR          | 17.741.158        | 4,83                              | TURKCELL ILETISM  |        |              |          |                                   |
| SHRIRAM TRANSPORT FINANCE   | 365.821    | INR          | 10.350.582        | 2,81                              | HIZMETLERI  |        |              |          |                                   |
| ZOMATO  | 3.258.057  | INR          | 7.113.602         | 1,93                              | 1.966.526 TRY 4.157.714 1,13                                    |        |              |          |                                   |
|   |            |              | <b>55.077.837</b> | <b>14,96</b>                      | <b>4.157.714 1,13</b>   |        |              |          |                                   |
| <b>INDONESIEN</b>   |            |              |                   |                                   | <b>SUMME AKTIEN</b>   |        |              |          |                                   |
| BANK RAKYAT INDONESIA   | 31.770.801 | IDR          | 12.123.201        | 3,29                              | <b>341.532.024 92,77</b>  |        |              |          |                                   |
|   |            |              | <b>12.123.201</b> | <b>3,29</b>                       | <b>DEPOSITARY RECEIPTS</b>                                      |        |              |          |                                   |
| <b>KENIA</b>  |            |              |                   |                                   | <b>BRASILIEN</b>  |        |              |          |                                   |
| SAFARICOM   | 48.735.108 | KES          | 6.565.830         | 1,78                              | BANCO BRADESCO  |        |              |          |                                   |
|   |            |              | <b>6.565.830</b>  | <b>1,78</b>                       | 1.546.238 USD 4.460.896 1,21                                    |        |              |          |                                   |
|   |            |              |                   |                                   | <b>4.460.896 1,21</b>   |        |              |          |                                   |
|   |            |              |                   |                                   | <b>CHINA</b>  |        |              |          |                                   |
|   |            |              |                   |                                   | NETEASE   |        |              |          |                                   |
|   |            |              |                   |                                   | 19.282 USD 2.001.086 0,54                                       |        |              |          |                                   |
|   |            |              |                   |                                   | <b>2.001.086 0,54</b>   |        |              |          |                                   |
|   |            |              |                   |                                   | <b>INDIEN</b>   |        |              |          |                                   |
|   |            |              |                   |                                   | INFOSYS   |        |              |          |                                   |
|   |            |              |                   |                                   | 116.297 USD 2.090.439 0,57                                      |        |              |          |                                   |
|   |            |              |                   |                                   | <b>2.090.439 0,57</b>   |        |              |          |                                   |
|   |            |              |                   |                                   | <b>SUMME DEPOSITARY RECEIPTS</b>                                |        |              |          |                                   |
|   |            |              |                   |                                   | <b>8.552.421 2,32</b>   |        |              |          |                                   |
|   |            |              |                   |                                   | <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTEN WERTPAPIERE</b> |        |              |          |                                   |
|   |            |              |                   |                                   | <b>350.084.445 95,09</b>  |        |              |          |                                   |
|   |            |              |                   |                                   | <b>WERTPAPIERE</b>  |        |              |          |                                   |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Emerging Markets Equity (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung   | Anzahl    | Wäh-<br>rung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |
|--|-----------|--------------|--------------------|-----------------------------------|
| <b>AN EINEM ANDEREM GEREGLTEN MARKT<br/>GEHANDELTE, ÜBERTRAGBARE<br/>WERTPAPIERE</b> |           |              |                    |                                   |
| <b>AKTIEN</b>  |           |              |                    |                                   |
| <b>MEXIKO</b>  |           |              |                    |                                   |
| GENTERA  | 6.940.177 | MXN          | 11.878.896         | 3,23                              |
|  |           |              | <b>11.878.896</b>  | <b>3,23</b>                       |
| <b>SUMME AKTIEN</b>  |           |              | <b>11.878.896</b>  | <b>3,23</b>                       |
| <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN<br/>MARKT GEHANDELTEN ÜBERTRAGBAREN WERTPAPIERE</b>  |           |              | <b>11.878.896</b>  | <b>3,23</b>                       |
| <b>SUMME WERTPAPIERANLAGEN</b>   |           |              | <b>361.963.341</b> | <b>98,32</b>                      |
| <b>SONSTIGES NETTOVERMÖGEN</b>   |           |              | <b>6.174.750</b>   | <b>1,68</b>                       |
| <b>GESAMTNETTOVERMÖGEN</b>   |           |              | <b>368.138.091</b> | <b>100,00</b>                     |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Equity Circular Economy  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl  | Wäh-<br>rung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens | Beschreibung  | Anzahl  | Wäh-<br>rung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |              |
|---|---------|--------------|------------------|-----------------------------------|---|---------|--------------|--------------------|-----------------------------------|--------------|
| <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>  |         |              |                  |                                   | <b>ASML HOLDING</b>   |         |              |                    |                                   |              |
| <b>AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |         |              |                  |                                   | <b>NORWEGEN</b>   |         |              |                    |                                   |              |
| <b>AKTIEN</b>   |         |              |                  |                                   | <b>NORSK HYDRO</b>  |         |              |                    |                                   |              |
| <b>AUSTRALIEN</b>   |         |              |                  |                                   | <b>TOMRA SYSTEMS</b>  |         |              |                    |                                   |              |
| BRAMBLES  | 229.135 | AUD          | 2.414.226        | 2,14                              |   |         |              | <b>3.927.735</b>   | <b>3,48</b>                       |              |
|   |         |              | <b>2.414.226</b> | <b>2,14</b>                       |   |         |              | <b>4.610.379</b>   | <b>4,08</b>                       |              |
| <b>BELGIEN</b>  |         |              |                  |                                   | <b>SPANIEN</b>  |         |              |                    |                                   |              |
| ELIA GROUP  | 13.003  | EUR          | 1.407.133        | 1,25                              | CELLNEX TELECOM   | 47.425  | EUR          | 1.676.910          | 1,49                              |              |
|   |         |              | <b>1.407.133</b> | <b>1,25</b>                       |   |         |              | <b>1.676.910</b>   | <b>1,49</b>                       |              |
| <b>KANADA</b>   |         |              |                  |                                   | <b>SCHWEDEN</b>   |         |              |                    |                                   |              |
| SHOPIFY   | 17.788  | CAD          | 1.398.854        | 1,24                              | TELIASONERA   | 719.508 | SEK          | 1.845.772          | 1,64                              |              |
| STANTEC   | 35.830  | USD          | 2.988.938        | 2,65                              |   |         |              | <b>1.845.772</b>   | <b>1,64</b>                       |              |
|   |         |              | <b>4.387.792</b> | <b>3,89</b>                       | <b>SCHWEIZ</b>  |         |              |                    |                                   |              |
| <b>DÄNEMARK</b>   |         |              |                  |                                   | <b>ON HOLDING AG</b>  |         |              |                    |                                   |              |
| NOVOZYMES   | 45.075  | DKK          | 2.644.522        | 2,34                              |   | 42.663  | USD          | 1.517.950          | 1,34                              |              |
|   |         |              | <b>2.644.522</b> | <b>2,34</b>                       |   |         |              | <b>1.517.950</b>   | <b>1,34</b>                       |              |
| <b>FINNLAND</b>   |         |              |                  |                                   | <b>USA</b>  |         |              |                    |                                   |              |
| MARIMEKKO   | 68.831  | EUR          | 932.192          | 0,83                              | ADVANCED DRAINAGE   |         |              |                    |                                   |              |
| VALMET CORP   | 70.291  | EUR          | 1.854.586        | 1,64                              | SYSTEMS   | 17.901  | USD          | 3.111.194          | 2,76                              |              |
|   |         |              | <b>2.786.778</b> | <b>2,47</b>                       | ANSYS   | 6.104   | USD          | 2.121.079          | 1,88                              |              |
| <b>FRANKREICH</b>   |         |              |                  |                                   | AUTODESK  |         |              |                    |                                   |              |
| CARREFOUR   | 73.535  | EUR          | 1.257.581        | 1,11                              | CINTAS  | 4.580   | USD          | 3.146.964          | 2,79                              |              |
| KERING  | 2.841   | EUR          | 1.121.456        | 0,99                              | CISCO SYSTEMS   | 56.942  | USD          | 2.857.350          | 2,53                              |              |
| L'OREAL   | 6.880   | EUR          | 3.263.803        | 2,89                              | COPART  | 37.337  | USD          | 2.166.666          | 1,92                              |              |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT  | 101.638 | EUR          | 3.305.145        | 2,94                              | CROWN HOLDING   | 11.015  | USD          | 871.727            | 0,77                              |              |
|   |         |              | <b>8.947.985</b> | <b>7,93</b>                       | ECOLAB  | 15.188  | USD          | 3.496.885          | 3,10                              |              |
| <b>DEUTSCHLAND</b>  |         |              |                  |                                   | EQUINIX REIT  |         |              |                    |                                   |              |
| BMW   | 21.267  | EUR          | 2.454.858        | 2,18                              | ETSY  | 7.559   | USD          | 524.443            | 0,46                              |              |
| MUENCHENER RUECK  | 5.395   | EUR          | 2.635.954        | 2,33                              | HOME DEPOT  | 9.250   | USD          | 3.542.935          | 3,14                              |              |
|   |         |              | <b>5.090.812</b> | <b>4,51</b>                       | INGEVITY CORP   | 16.760  | USD          | 819.061            | 0,73                              |              |
| <b>GROSSBRITANNIEN</b>  |         |              |                  |                                   | KROGER  |         |              |                    |                                   |              |
| SEGRE REIT  | 139.558 | GBP          | 1.586.017        | 1,41                              | SPROUTS FARMERS   |         |              |                    |                                   |              |
| SSE   | 133.370 | GBP          | 2.781.612        | 2,46                              | MARKETS   | 45.664  | USD          | 2.961.767          | 2,62                              |              |
|   |         |              | <b>4.367.629</b> | <b>3,87</b>                       | TRIMBLE NAVIGATION  | 44.773  | USD          | 2.839.056          | 2,52                              |              |
| <b>IRLAND</b>   |         |              |                  |                                   | UNITED RENTALS  |         |              |                    |                                   |              |
| KINGSPAN GROUP  | 19.492  | EUR          | 1.789.786        | 1,59                              | VISA „A“  | 6.901   | USD          | 1.920.893          | 1,70                              |              |
|   |         |              | <b>1.789.786</b> | <b>1,59</b>                       | WASTE MAN   | 16.232  | USD          | 3.457.741          | 3,06                              |              |
| <b>JAPAN</b>  |         |              |                  |                                   | WESTROCK  |         |              |                    |                                   |              |
| AJINOMOTO   | 43.700  | JPY          | 1.626.208        | 1,44                              |   | 22.023  | USD          | 1.080.889          | 0,96                              |              |
| CANON   | 67.200  | JPY          | 1.998.527        | 1,77                              |   |         |              | <b>48.392.524</b>  | <b>42,88</b>                      |              |
| KURITA WATER INDUSTRIES   | 36.900  | JPY          | 1.524.812        | 1,35                              | <b>SUMME AKTIEN</b>   |         |              |                    |                                   |              |
| MITSUBISHI ELECTRIC   | 114.300 | JPY          | 1.904.308        | 1,69                              |   |         |              | <b>103.003.071</b> | <b>91,27</b>                      |              |
|   |         |              | <b>7.053.855</b> | <b>6,25</b>                       | <b>DEPOSITARY RECEIPTS</b>                                      |         |              |                    |                                   |              |
| <b>LUXEBURG</b>   |         |              |                  |                                   | <b>INDIEN</b>   |         |              |                    |                                   |              |
| BEFESA  | 43.051  | EUR          | 1.479.473        | 1,31                              | INFOSYS   | 115.602 | USD          | 2.077.946          | 1,84                              |              |
|   |         |              | <b>1.479.473</b> | <b>1,31</b>                       |   |         |              | <b>2.077.946</b>   | <b>1,84</b>                       |              |
| <b>NIEDERLANDE</b>  |         |              |                  |                                   | <b>SÜDKOREA</b>   |         |              |                    |                                   |              |
| ADVANCED METALLURGICAL  | 30.056  | EUR          | 682.644          | 0,60                              | SAMSUNG ELECTRONICS   | 1.194   | USD          | 1.783.836          | 1,58                              |              |
|   |         |              |                  |                                   |   |         |              | <b>1.783.836</b>   | <b>1,58</b>                       |              |
|   |         |              |                  |                                   | <b>SUMME DEPOSITARY RECEIPTS</b>                                |         |              |                    |                                   |              |
|   |         |              |                  |                                   | <b>3.861.782</b>  |         |              |                    |                                   | <b>3,42</b>  |
|   |         |              |                  |                                   | <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTEN WERTPAPIERE</b> |         |              |                    |                                   |              |
|   |         |              |                  |                                   | <b>106.864.853</b>  |         |              |                    |                                   | <b>94,69</b> |
|   |         |              |                  |                                   | <b>WERTPAPIERE</b>  |         |              |                    |                                   |              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Equity Circular Economy (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl    | Wäh-<br>rung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |
|---|-----------|--------------|--------------------|-----------------------------------|
| <b>AN EINEM ANDEREM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE, ÜBERTRAGBARE<br/>WERTPAPIERE</b>    |           |              |                    |                                   |
| <b>AKTIEN</b>   |           |              |                    |                                   |
| <b>ITALIEN</b>  |           |              |                    |                                   |
| INTESA BCI  | 1.057.480 | EUR          | 3.839.667          | 3,40                              |
|   |           |              | <b>3.839.667</b>   | <b>3,40</b>                       |
| <b>SUMME AKTIEN</b>   |           |              | <b>3.839.667</b>   | <b>3,40</b>                       |
| <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN<br/>MARKT GEHANDELTEN ÜBERTRAGBAREN WERTPAPIERE</b> |           |              | <b>3.839.667</b>   | <b>3,40</b>                       |
| <b>SUMME WERTPAPIERANLAGEN</b>  |           |              | <b>110.704.520</b> | <b>98,09</b>                      |
| <b>SONSTIGES NETTOVERMÖGEN</b>  |           |              | <b>2.161.087</b>   | <b>1,91</b>                       |
| <b>GESAMTNETTOVERMÖGEN</b>  |           |              | <b>112.865.607</b> | <b>100,00</b>                     |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Equity Climate Change  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl    | Wäh-<br>rung | Kurswert   | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens | Beschreibung  | Anzahl                         | Wäh-<br>rung | Kurswert   | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |      |
|---|-----------|--------------|------------|-----------------------------------|---|--------------------------------|--------------|------------|-----------------------------------|------|
| <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>  |           |              |            |                                   | <b>SCHWEIZ</b>  |                                |              |            |                                   |      |
| <b>AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |           |              |            |                                   | DSM FIRMENICH   |                                |              |            |                                   |      |
| <b>AKTIEN</b>   |           |              |            |                                   | 31.351 EUR 3.576.873 1,15   |                                |              |            |                                   |      |
| <b>BELGIEN</b>  |           |              |            |                                   | <b>USA</b>  |                                |              |            |                                   |      |
| SYENSQO   | 16.920    | EUR          | 1.599.305  | 0,51                              | ADVANCED DRAINAGE SYSTEMS   | 39.968                         | USD          | 6.946.438  | 2,24                              |      |
|   |           |              |            | <b>1.599.305</b>                  | <b>0,51</b>   | AGILENT TECHNOLOGIES           | 44.835       | USD        | 6.551.739                         | 2,11 |
| <b>CHINA</b>  |           |              |            |                                   | AUTODESK  |                                |              |            |                                   |      |
| BYD „H“   | 237.000   | HKD          | 6.104.838  | 1,97                              | BALL  | 118.125                        | USD          | 8.005.331  | 2,58                              |      |
| CIMC ENRIC HOLDING  | 4.980.000 | HKD          | 5.064.978  | 1,63                              | CADENCE DESIGN SYSTEM   | 16.035                         | USD          | 4.999.072  | 1,61                              |      |
| NARI TECHNOLOGY DEVELOPMENT                                       | 959.848   | CNY          | 3.201.950  | 1,03                              | DANAHER   | 26.042                         | USD          | 6.493.312  | 2,09                              |      |
| SUNGROW POWER SUPPLY  | 161.700   | CNY          | 2.308.897  | 0,74                              | DEERE   | 14.736                         | USD          | 6.028.203  | 1,94                              |      |
|   |           |              |            | <b>16.680.663</b>                 | <b>5,37</b>   | ECOLAB                         | 62.679       | USD        | 14.431.213                        | 4,63 |
| <b>DÄNEMARK</b>   |           |              |            |                                   | ENPHASE ENERGY  |                                |              |            |                                   |      |
| VESTAS WIND SYSTEM  | 322.928   | DKK          | 9.024.123  | 2,90                              | FIRST SOLAR   | 56.090                         | USD          | 9.428.168  | 3,03                              |      |
|   |           |              |            | <b>9.024.123</b>                  | <b>2,90</b>   | HUBBELL                        | 22.993       | USD        | 9.561.639                         | 3,08 |
| <b>FINNLAND</b>   |           |              |            |                                   | MICROSOFT   |                                |              |            |                                   |      |
| NESTE OIL   | 126.424   | EUR          | 3.424.371  | 1,10                              | PROLOGIS  | 56.092                         | USD          | 7.250.452  | 2,33                              |      |
|   |           |              |            | <b>3.424.371</b>                  | <b>1,10</b>   | TRIMBLE NAVIGATION             | 53.254       | USD        | 3.376.836                         | 1,09 |
| <b>FRANKREICH</b>   |           |              |            |                                   | VERALTO CORP  |                                |              |            |                                   |      |
| CAP GEMINI  | 49.156    | EUR          | 11.318.463 | 3,64                              | VERISK ANALYTICS  | 43.926                         | USD          | 10.330.956 | 3,32                              |      |
| SCHNEIDER ELTE  | 66.399    | EUR          | 15.016.266 | 4,83                              | WASTE MAN   | 11.463                         | USD          | 2.441.848  | 0,79                              |      |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT  | 50.479    | EUR          | 1.641.516  | 0,53                              | WATTS WATER TECHNOLOGIES  | 56.079                         | USD          | 11.922.395 | 3,84                              |      |
|   |           |              |            | <b>27.976.245</b>                 | <b>9,00</b>   | <b>SUMME AKTIEN</b>            |              |            |                                   |      |
| <b>DEUTSCHLAND</b>  |           |              |            |                                   | <b>304.733.485 98,06</b>  |                                |              |            |                                   |      |
| INFINEON TECHNOLOGIES   | 287.241   | EUR          | 9.776.591  | 3,15                              | <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTEN WERTPAPIERE</b>                 |                                |              |            |                                   |      |
|   |           |              |            | <b>9.776.591</b>                  | <b>3,15</b>   | <b>304.733.485 98,06</b>       |              |            |                                   |      |
| <b>GROSSBRITANNIEN</b>  |           |              |            |                                   | <b>AN EINEM ANDEREM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE, ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>    |                                |              |            |                                   |      |
| ASHTHEAD GROUP  | 109.314   | GBP          | 7.799.375  | 2,51                              | <b>AKTIEN</b>   |                                |              |            |                                   |      |
| CRODA INTERNATIONAL SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING                  | 76.246    | GBP          | 4.726.312  | 1,52                              | <b>FRANKREICH</b>   |                                |              |            |                                   |      |
| SSE   | 181.959   | USD          | 6.670.617  | 2,15                              | SPIE  |                                |              |            |                                   |      |
| SSE   | 313.023   | GBP          | 6.528.519  | 2,10                              | 96.350 EUR 3.627.462 1,17   |                                |              |            |                                   |      |
|   |           |              |            | <b>25.724.823</b>                 | <b>8,28</b>   | <b>3.627.462 1,17</b>          |              |            |                                   |      |
| <b>IRLAND</b>   |           |              |            |                                   | <b>SUMME AKTIEN</b>   |                                |              |            |                                   |      |
| ACCENTURE CORP  | 37.840    | USD          | 12.981.012 | 4,18                              | <b>3.627.462 1,17</b>   |                                |              |            |                                   |      |
| SMURFIT KAPPA   | 128.876   | GBP          | 5.896.710  | 1,90                              | <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN MARKT GEHANDELTEN ÜBERTRAGBAREN WERTPAPIERE</b> |                                |              |            |                                   |      |
| TRANE TECHNOLOGIES  | 52.216    | USD          | 15.645.480 | 5,03                              | <b>3.627.462 1,17</b>   |                                |              |            |                                   |      |
|   |           |              |            | <b>34.523.202</b>                 | <b>11,11</b>  | <b>SUMME WERTPAPIERANLAGEN</b> |              |            |                                   |      |
| <b>ITALIEN</b>  |           |              |            |                                   | <b>308.360.947 99,23</b>  |                                |              |            |                                   |      |
| PRYSMIAN  | 288.125   | EUR          | 15.067.092 | 4,85                              | <b>SONSTIGES NETTOVERMÖGEN</b>  |                                |              |            |                                   |      |
|   |           |              |            | <b>15.067.092</b>                 | <b>4,85</b>   | <b>2.383.304 0,77</b>          |              |            |                                   |      |
| <b>JAPAN</b>  |           |              |            |                                   | <b>GESAMTNETTOVERMÖGEN</b>  |                                |              |            |                                   |      |
| AZBIL CORP  | 214.600   | JPY          | 5.911.443  | 1,91                              | <b>310.744.251 100,00</b>   |                                |              |            |                                   |      |
| OMRON   | 91.000    | JPY          | 3.242.076  | 1,04                              |   |                                |              |            |                                   |      |
|   |           |              |            | <b>9.153.519</b>                  | <b>2,95</b>   |                                |              |            |                                   |      |
| <b>SPANIEN</b>  |           |              |            |                                   |   |                                |              |            |                                   |      |
| EDP RENOVAVEIS  | 506.125   | EUR          | 6.876.416  | 2,21                              |   |                                |              |            |                                   |      |
|   |           |              |            | <b>6.876.416</b>                  | <b>2,21</b>   |                                |              |            |                                   |      |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Equity Sustainable Healthcare  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl    | Wäh-<br>rung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens | Beschreibung  | Anzahl  | Wäh-<br>rung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |
|---|-----------|--------------|-------------------|-----------------------------------|---|---------|--------------|--------------------|-----------------------------------|
| <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>  |           |              |                   |                                   |   |         |              |                    |                                   |
| <b>AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |           |              |                   |                                   |   |         |              |                    |                                   |
| <b>AKTIEN</b>   |           |              |                   |                                   |   |         |              |                    |                                   |
| <b>COSTA RICA</b>   |           |              |                   |                                   |   |         |              |                    |                                   |
| ESTABLISHMENT LABS HOLDINGS                                       | 162.496   | USD          | 8.344.170         | 2,76                              | R1 RCM  | 297.559 | USD          | 3.929.267          | 1,30                              |
|   |           |              | <b>8.344.170</b>  | <b>2,76</b>                       | REGENERON PHARMS  | 8.194   | USD          | 7.919.747          | 2,62                              |
| <b>DÄNEMARK</b>   |           |              |                   |                                   |   |         |              |                    |                                   |
| COLOPLAST „B“   | 36.345    | DKK          | 4.906.693         | 1,62                              | REVOLUTION MEDICINES  | 143.932 | USD          | 4.659.079          | 1,54                              |
| NOVO NORDISK  | 109.442   | DKK          | 13.965.284        | 4,62                              | SAREPTA THERAPEUTICS  | 40.806  | USD          | 5.297.435          | 1,75                              |
|   |           |              | <b>18.871.977</b> | <b>6,24</b>                       | STRYKER   | 18.002  | USD          | 6.459.298          | 2,14                              |
| <b>FRANKREICH</b>   |           |              |                   |                                   |   |         |              |                    |                                   |
| SANOFI  | 47.873    | EUR          | 4.707.026         | 1,56                              | SUPERNUS  |         |              |                    |                                   |
|   |           |              | <b>4.707.026</b>  | <b>1,56</b>                       | PHARMACEUTICALS   | 170.542 | USD          | 5.760.909          | 1,91                              |
| <b>DEUTSCHLAND</b>  |           |              |                   |                                   |   |         |              |                    |                                   |
| MERCK KGAA  | 18.044    | EUR          | 3.190.107         | 1,06                              | TENET HEALTHCARE  | 114.856 | USD          | 12.094.336         | 4,00                              |
| SCHOTT PHARMA AG & CO   | 75.808    | EUR          | 3.225.782         | 1,06                              | THERMO FISHER SCIENTIFIC  | 10.690  | USD          | 6.191.007          | 2,05                              |
|   |           |              | <b>6.415.889</b>  | <b>2,12</b>                       | TRANSMEDICS GROUP   | 72.859  | USD          | 5.570.799          | 1,84                              |
| <b>GROSSBRITANNIEN</b>  |           |              |                   |                                   |   |         |              |                    |                                   |
| ASTRAZENECA   | 47.311    | GBP          | 6.399.954         | 2,12                              | UNITED THERAPEUTICS   | 27.965  | USD          | 6.730.337          | 2,23                              |
| ROIVANT SCIENCES  | 436.928   | USD          | 4.587.744         | 1,52                              | UNITEDHEALTH GP   | 23.643  | USD          | 11.650.087         | 3,85                              |
|   |           |              | <b>10.987.698</b> | <b>3,64</b>                       | VERTEX PHARMACEUTICALS  | 23.489  | USD          | 9.860.447          | 3,26                              |
| <b>IRLAND</b>   |           |              |                   |                                   |   |         |              |                    |                                   |
| UNIPHAR   | 1.335.442 | GBP          | 3.812.613         | 1,26                              |   |         |              | <b>218.094.150</b> | <b>72,16</b>                      |
|   |           |              | <b>3.812.613</b>  | <b>1,26</b>                       | <b>SUMME AKTIEN</b>   |         |              | <b>281.794.794</b> | <b>93,23</b>                      |
| <b>SCHWEIZ</b>  |           |              |                   |                                   |   |         |              |                    |                                   |
| LONZA GROUP   | 9.330     | CHF          | 5.579.147         | 1,84                              | <b>DEPOSITARY RECEIPTS</b>  |         |              |                    |                                   |
| ZUR ROSE GROUP  | 49.285    | CHF          | 4.982.124         | 1,65                              | <b>NIEDERLANDE</b>  |         |              |                    |                                   |
|   |           |              | <b>10.561.271</b> | <b>3,49</b>                       | ARGENX  | 14.346  | USD          | 5.670.974          | 1,88                              |
| <b>USA</b>  |           |              |                   |                                   |   |         |              |                    |                                   |
| ANTHEM  | 14.507    | USD          | 7.550.894         | 2,50                              |   |         |              | <b>5.670.974</b>   | <b>1,88</b>                       |
| APELLIS PHARMACEUTICALS   | 95.397    | USD          | 5.517.762         | 1,83                              |   |         |              | <b>5.670.974</b>   | <b>1,88</b>                       |
| ARCUTIS BIOTHERAPEUTICS   | 497.921   | USD          | 4.949.335         | 1,64                              | <b>SUMME DEPOSITARY RECEIPTS</b>  |         |              |                    |                                   |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL   | 38.797    | USD          | 3.424.223         | 1,13                              | <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTEN WERTPAPIERE WERTPAPIERE</b> |         |              | <b>287.465.768</b> | <b>95,11</b>                      |
| BOSTON SCIENTIFIC   | 136.329   | USD          | 9.364.439         | 3,10                              | <b>SUMME WERTPAPIERANLAGEN</b>  |         |              | <b>287.465.768</b> | <b>95,11</b>                      |
| DEXCOM  | 60.469    | USD          | 8.474.126         | 2,80                              | <b>SONSTIGES NETTOVERMÖGEN</b>  |         |              | <b>14.782.374</b>  | <b>4,89</b>                       |
| ELI LILLY   | 28.298    | USD          | 22.286.372        | 7,38                              | <b>GESAMTNETTOVERMÖGEN</b>  |         |              | <b>302.248.142</b> | <b>100,00</b>                     |
| EVOLENT HEALTH  | 138.794   | USD          | 4.595.469         | 1,52                              |   |         |              |                    |                                   |
| HALOZYME THERAPEUTICS   | 93.985    | USD          | 3.846.806         | 1,27                              |   |         |              |                    |                                   |
| INSPIRE MEDICAL SYSTEMS   | 23.479    | USD          | 5.204.355         | 1,72                              |   |         |              |                    |                                   |
| INSULET   | 22.117    | USD          | 3.770.285         | 1,25                              |   |         |              |                    |                                   |
| INTUITIVE SURGICAL  | 15.786    | USD          | 6.321.188         | 2,09                              |   |         |              |                    |                                   |
| MADRIGAL PHARMACEUTICALS  | 20.835    | USD          | 5.483.147         | 1,81                              |   |         |              |                    |                                   |
| MCKESSON HBOC   | 19.528    | USD          | 10.503.135        | 3,48                              |   |         |              |                    |                                   |
| MERCK & CO  | 79.169    | USD          | 10.433.683        | 3,45                              |   |         |              |                    |                                   |
| NATERA  | 56.233    | USD          | 5.184.683         | 1,72                              |   |         |              |                    |                                   |
| NEUROCRINE BIOSCIENCES  | 62.037    | USD          | 8.549.939         | 2,83                              |   |         |              |                    |                                   |
| PROCEPT BIROBOTICS  | 129.172   | USD          | 6.511.561         | 2,15                              |   |         |              |                    |                                   |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Infrastructure Equity  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl      | Wäh-<br>rung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens | Beschreibung   | Anzahl    | Wäh-<br>rung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |
|---|-------------|--------------|--------------------|-----------------------------------|--|-----------|--------------|--------------------|-----------------------------------|
| <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>  |             |              |                    |                                   | <b>SPANIEN</b>   |           |              |                    |                                   |
| <b>AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |             |              |                    |                                   | <b>CELLNEX TELECOM</b>   |           |              |                    |                                   |
| <b>AKTIEN</b>   |             |              |                    |                                   | <b>SCHWEIZ</b>   |           |              |                    |                                   |
| <b>AUSTRALIEN</b>   |             |              |                    |                                   | <b>FLUGHAFEN ZUERICH</b>   |           |              |                    |                                   |
| TRANSURBAN GROUP  | 920.927     | AUD          | 8.002.826          | 0,91                              |  | 94.088    | CHF          | 21.372.715         | 2,42                              |
|   |             |              | <b>8.002.826</b>   | <b>0,91</b>                       |  |           |              | <b>21.372.715</b>  | <b>2,42</b>                       |
| <b>BRASILIEN</b>  |             |              |                    |                                   | <b>USA</b>   |           |              |                    |                                   |
| ECORODOVIAS   |             |              |                    |                                   | AMERICAN TOWER   | 269.890   | USD          | 53.276.286         | 6,03                              |
| INFRAESTRUTURA E LOGISTICA  | 6.582.700   | BRL          | 10.836.261         | 1,23                              | ATMOS ENERGY   | 159.255   | USD          | 18.932.234         | 2,14                              |
|   |             |              | <b>10.836.261</b>  | <b>1,23</b>                       | CHENIERE ENERGY  | 265.402   | USD          | 42.597.021         | 4,82                              |
| <b>KANADA</b>   |             |              |                    |                                   | <b>DOMINION RESOURCES</b>  |           |              |                    |                                   |
| ENBRIDGE  | 331.519     | CAD          | 11.974.616         | 1,36                              | EDISON INTERNATIONAL   | 495.673   | USD          | 34.905.293         | 3,95                              |
| GIBSON ENERGY   | 1.512.143   | CAD          | 25.801.132         | 2,92                              | EVERSOURCE ENERGY  | 548.140   | USD          | 32.570.479         | 3,69                              |
| KEYERA  | 954.501     | CAD          | 24.496.449         | 2,77                              | EXELON   | 482.041   | USD          | 18.028.333         | 2,04                              |
| PEMBINA PIPELINE  | 30.000      | CAD          | 1.058.563          | 0,12                              | NISOURCE   | 735.660   | USD          | 20.241.685         | 2,29                              |
| PEMBINA PIPELINE CORP   | 1.077.173   | CAD          | 38.040.345         | 4,31                              | PINNACLE WEST CAPITAL  | 187.702   | USD          | 13.903.087         | 1,57                              |
|   |             |              | <b>101.371.105</b> | <b>11,48</b>                      | SEMPRA   | 562.680   | USD          | 40.355.410         | 4,57                              |
| <b>CHINA</b>  |             |              |                    |                                   | <b>TARGA RESOURCES</b>   |           |              |                    |                                   |
| BEIJING CAPITAL   |             |              |                    |                                   | WILLIAMS COMPANIES   | 1.132.716 | USD          | 44.017.344         | 4,98                              |
| INTERNATIONAL AIRPORT „H“   | 14.208.000  | HKD          | 4.302.456          | 0,49                              |  |           |              | <b>414.726.121</b> | <b>46,94</b>                      |
| CHINA TOWER CORP  | 151.566.000 | HKD          | 17.429.282         | 1,97                              | <b>SUMME AKTIEN</b>  |           |              |                    |                                   |
| ENN ENERGY HOLDINGS   | 2.048.500   | HKD          | 15.782.960         | 1,79                              |  |           |              | <b>789.764.780</b> | <b>89,41</b>                      |
| ZHEJIANG EXPRESSWAY „H“   | 12.170.000  | HKD          | 7.806.017          | 0,88                              | <b>DEPOSITARY RECEIPTS</b>   |           |              |                    |                                   |
|   |             |              | <b>45.320.715</b>  | <b>5,13</b>                       | <b>MEXIKO</b>  |           |              |                    |                                   |
| <b>FRANKREICH</b>   |             |              |                    |                                   | <b>GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE</b>                                       |           |              |                    |                                   |
| VINCI   | 177.088     | EUR          | 22.766.998         | 2,58                              |  | 76.125    | USD          | 24.283.875         | 2,75                              |
|   |             |              | <b>22.766.998</b>  | <b>2,58</b>                       |  |           |              | <b>24.283.875</b>  | <b>2,75</b>                       |
| <b>GROSSBRITANNIEN</b>  |             |              |                    |                                   | <b>SUMME DEPOSITARY RECEIPTS</b>   |           |              |                    |                                   |
| NATIONAL GRID   | 2.903.711   | GBP          | 39.047.059         | 4,42                              |  |           |              | <b>24.283.875</b>  | <b>2,75</b>                       |
| PENNON GROUP  | 1.260.871   | GBP          | 10.329.277         | 1,17                              | <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTEN WERTPAPIERE</b>              |           |              |                    |                                   |
|   |             |              | <b>49.376.336</b>  | <b>5,59</b>                       |  |           |              | <b>814.048.655</b> | <b>92,16</b>                      |
| <b>HONGKONG</b>   |             |              |                    |                                   | <b>AN EINEM ANDEREM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE, ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |           |              |                    |                                   |
| CHINA RESOURCES GAS GROUP   | 5.485.900   | HKD          | 17.488.543         | 1,98                              | <b>AKTIEN</b>  |           |              |                    |                                   |
| CHINA WATER AFFAIRS GROUP   | 6.760.000   | HKD          | 3.964.556          | 0,45                              | <b>FRANKREICH</b>  |           |              |                    |                                   |
|   |             |              | <b>21.453.099</b>  | <b>2,43</b>                       | <b>EIFFAGE</b>   |           |              |                    |                                   |
| <b>ITALIEN</b>  |             |              |                    |                                   | <b>RAI WAY</b>   |           |              |                    |                                   |
| RAI WAY   | 4.242.316   | EUR          | 23.779.028         | 2,69                              |  | 274.885   | EUR          | 31.290.707         | 3,54                              |
|   |             |              | <b>23.779.028</b>  | <b>2,69</b>                       |  |           |              | <b>31.290.707</b>  | <b>3,54</b>                       |
| <b>NIEDERLANDE</b>  |             |              |                    |                                   | <b>ITALIEN</b>   |           |              |                    |                                   |
| VOPAK KON   | 849.050     | EUR          | 32.699.290         | 3,70                              | <b>ITALGAS</b>   |           |              |                    |                                   |
|   |             |              | <b>32.699.290</b>  | <b>3,70</b>                       |  | 2.561.439 | EUR          | 14.924.479         | 1,69                              |
|   |             |              |                    |                                   |  |           |              | <b>14.924.479</b>  | <b>1,69</b>                       |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Infrastructure Equity (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung                                       | Anzahl    | Wäh-<br>rung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |
|--|-----------|--------------|--------------------|-----------------------------------|
| <b>USA</b>   |           |              |                    |                                   |
| PLAINS GP HOLDINGS LP                              |           |              |                    |                                   |
| INT CL COM A NPV                                   | 1.116.583 | USD          | 20.310.645         | 2,30                              |
|  |           |              | <b>20.310.645</b>  | <b>2,30</b>                       |
| <b>SUMME AKTIEN</b>                                |           |              | <b>66.525.831</b>  | <b>7,53</b>                       |
| <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN</b>                |           |              |                    |                                   |
| <b>MARKT GEHANDELTEN ÜBERTRAGBAREN WERTPAPIERE</b> |           |              | <b>66.525.831</b>  | <b>7,53</b>                       |
| <b>SUMME WERTPAPIERANLAGEN</b>                     |           |              | <b>880.574.486</b> | <b>99,69</b>                      |
| <b>SONSTIGES NETTOVERMÖGEN</b>                     |           |              | <b>2.705.924</b>   | <b>0,31</b>                       |
| <b>GESAMTNETTOVERMÖGEN</b>                         |           |              | <b>883.280.410</b> | <b>100,00</b>                     |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Real Estate Equity  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl    | Wäh-<br>rung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens | Beschreibung  | Anzahl  | Wäh-<br>rung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |
|---|-----------|--------------|-------------------|-----------------------------------|---|---------|--------------|--------------------|-----------------------------------|
| <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>  |           |              |                   |                                   | <b>USA</b>  |         |              |                    |                                   |
| <b>AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |           |              |                   |                                   | <b>ALEXANDRIA REAL ESTATE REIT</b>  |         |              |                    |                                   |
| <b>AKTIEN</b>   |           |              |                   |                                   | 117.487 USD 15.174.621 2,36   |         |              |                    |                                   |
| <b>AUSTRALIEN</b>   |           |              |                   |                                   | AVALONBAY COMMUNITIES 81.421 USD 15.140.235 2,35                                |         |              |                    |                                   |
| VICINITY CENTRES REIT   | 8.455.660 | AUD          | 11.750.086        | 1,83                              | BROADSTONE NET LEASE  | 585.451 | USD          | 9.156.454          | 1,42                              |
|   |           |              | <b>11.750.086</b> | <b>1,83</b>                       | CAMDEN PROPERTY REIT  | 64.366  | USD          | 6.318.810          | 0,98                              |
| <b>BELGIEN</b>  |           |              |                   |                                   | COUSINS PROPERTIES 274.452 USD 6.575.870 1,02                                   |         |              |                    |                                   |
| WAREHOUSES DE PAUW  | 651.292   | EUR          | 18.597.772        | 2,89                              | CUBESMART   | 110.087 | USD          | 4.990.244          | 0,78                              |
|   |           |              | <b>18.597.772</b> | <b>2,89</b>                       | DIGITAL REALTY TRUST REIT   | 55.191  | USD          | 7.972.340          | 1,24                              |
| <b>KANADA</b>   |           |              |                   |                                   | EQUINIX REIT 41.270 USD 33.985.844 5,28   |         |              |                    |                                   |
| DREAM INDUSTRIAL  | 820.738   | CAD          | 7.957.201         | 1,24                              | EQUITY LIFESTYLE  |         |              |                    |                                   |
| RIOCAN REIT   | 593.013   | CAD          | 8.100.385         | 1,25                              | PROPERTIES REIT   | 207.657 | USD          | 13.400.106         | 2,08                              |
|   |           |              | <b>16.057.586</b> | <b>2,49</b>                       | EQUITY RESIDENTIAL  | 239.698 | USD          | 15.132.135         | 2,35                              |
| <b>FRANKREICH</b>   |           |              |                   |                                   | ESSEX PROPERTY REIT 38.737 USD 9.467.710 1,47                                   |         |              |                    |                                   |
| KLEPIERRE   | 189.401   | EUR          | 4.913.365         | 0,76                              | FEDERAL REALTY  |         |              |                    |                                   |
|   |           |              | <b>4.913.365</b>  | <b>0,76</b>                       | INVESTMENT TRUST  | 111.484 | USD          | 11.399.239         | 1,77                              |
| <b>DEUTSCHLAND</b>  |           |              |                   |                                   | HEALTHPEAK 458.157 USD 8.565.245 1,33   |         |              |                    |                                   |
| DEUTSCHE ANNINGTON  | 328.285   | EUR          | 9.668.518         | 1,50                              | INVITATION HOMES REIT   | 636.816 | USD          | 22.505.077         | 3,50                              |
| IMMOBILIEN  |           |              |                   |                                   | KIMCO REALTY  | 696.486 | USD          | 13.626.749         | 2,12                              |
| LEG IMMOBILIEN GMBH   | 89.599    | EUR          | 7.675.551         | 1,19                              | NATIONAL RETAIL   |         |              |                    |                                   |
|   |           |              | <b>17.344.069</b> | <b>2,69</b>                       | PROPERTIES  | 256.335 | USD          | 10.960.885         | 1,70                              |
| <b>GROSSBRITANNIEN</b>  |           |              |                   |                                   | PROLOGIS 405.902 USD 52.466.892 8,16  |         |              |                    |                                   |
| BIG YELLOW GROUP REIT   | 392.020   | GBP          | 5.259.228         | 0,82                              | PUBLIC STORAGE  | 66.257  | USD          | 19.180.076         | 2,98                              |
| BRITISH LAND REIT   | 1.119.424 | GBP          | 5.577.259         | 0,87                              | REALTY INCOME   | 462.249 | USD          | 24.940.645         | 3,88                              |
| DERWENT LONDON REIT   | 188.897   | GBP          | 5.163.826         | 0,80                              | REGENCY CENTERS   | 215.998 | USD          | 13.072.199         | 2,03                              |
| LAND SECURITIES   | 640.283   | GBP          | 5.294.650         | 0,82                              | REXFORD INDUSTRIAL  |         |              |                    |                                   |
| LONDONMETRIC PROPERTY   | 1.345.085 | GBP          | 3.449.332         | 0,54                              | REALTY  | 260.010 | USD          | 13.078.503         | 2,03                              |
| SEGRO REIT  | 1.517.726 | GBP          | 17.248.304        | 2,68                              | SIMON PROPERTY GROUP  | 145.681 | USD          | 22.630.087         | 3,52                              |
| UNITE GROUP   | 651.726   | GBP          | 8.055.920         | 1,25                              | TERRENO REALTY REIT   | 148.039 | USD          | 9.809.064          | 1,52                              |
|   |           |              | <b>50.048.519</b> | <b>7,78</b>                       | VENTAS  | 362.031 | USD          | 15.759.209         | 2,45                              |
| <b>HONGKONG</b>   |           |              |                   |                                   | <b>SUMME AKTIEN</b>   |         |              |                    |                                   |
| THE LINK REIT   | 1.378.474 | HKD          | 5.926.780         | 0,92                              |   |         |              | <b>563.772.998</b> | <b>87,59</b>                      |
|   |           |              | <b>5.926.780</b>  | <b>0,92</b>                       | <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTEN WERTPAPIERE</b>                 |         |              |                    |                                   |
| <b>JAPAN</b>  |           |              |                   |                                   | <b>563.772.998 87,59</b>  |         |              |                    |                                   |
| ADVANCE RESIDENCE   |           |              |                   |                                   | <b>AN EINEM ANDEREM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE, ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>    |         |              |                    |                                   |
| INVESTMENT  | 2.965     | JPY          | 6.562.985         | 1,02                              | <b>AKTIEN</b>   |         |              |                    |                                   |
| GLP REIT „J“  | 14.562    | JPY          | 12.200.348        | 1,90                              | <b>USA</b>  |         |              |                    |                                   |
| NIPPON BUILDING FUND  | 1.199     | JPY          | 4.792.990         | 0,74                              | WELLTOWER 251.446 USD 23.399.565 3,64   |         |              |                    |                                   |
| NIPPON PROLOGIS REIT  | 7.061     | JPY          | 12.578.186        | 1,95                              |   |         |              | <b>23.399.565</b>  | <b>3,64</b>                       |
|   |           |              | <b>36.134.509</b> | <b>5,61</b>                       | <b>SUMME AKTIEN</b>   |         |              |                    |                                   |
| <b>SINGAPUR</b>   |           |              |                   |                                   | <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN MARKT GEHANDELTEN ÜBERTRAGBAREN WERTPAPIERE</b> |         |              |                    |                                   |
| CAPITAMALL REIT   | 9.497.099 | SGD          | 13.933.207        | 2,17                              |   |         |              | <b>23.399.565</b>  | <b>3,64</b>                       |
| MAPLETREE LOGISTICS REIT  | 8.475.000 | SGD          | 9.168.272         | 1,42                              | <b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>  |         |              |                    |                                   |
|   |           |              | <b>23.101.479</b> | <b>3,59</b>                       | <b>FRANKREICH</b>   |         |              |                    |                                   |
| <b>SPANIEN</b>  |           |              |                   |                                   | GECINA 101.993 EUR 10.453.466 1,62  |         |              |                    |                                   |
| INMOBILIARIA COLONIAL   | 774.235   | EUR          | 4.590.594         | 0,71                              |   |         |              | <b>10.453.466</b>  | <b>1,62</b>                       |
|   |           |              | <b>4.590.594</b>  | <b>0,71</b>                       |   |         |              |                    |                                   |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Real Estate Equity (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung                                   | Anzahl  | Wäh-<br>rung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |
|--|---------|--------------|--------------------|-----------------------------------|
| <b>JAPAN</b>                                   |         |              |                    |                                   |
| UNITED URBAN INVESTMENT                        | 14.060  | JPY          | 14.297.360         | 2,22                              |
|  |         |              | <b>14.297.360</b>  | <b>2,22</b>                       |
| <b>USA</b>                                     |         |              |                    |                                   |
| EXTRA SPACE STORAGE                            | 93.552  | USD          | 13.786.758         | 2,15                              |
| FIRST INDUSTRIAL REALTY<br>TRUST               | 166.883 | USD          | 8.804.747          | 1,37                              |
|  |         |              | <b>22.591.505</b>  | <b>3,52</b>                       |
| <b>SUMME ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b> |         |              | <b>47.342.331</b>  | <b>7,36</b>                       |
| <b>SUMME WERTPAPIERANLAGEN</b>                 |         |              | <b>634.514.894</b> | <b>98,59</b>                      |
| <b>SONSTIGES NETTOVERMÖGEN</b>                 |         |              | <b>9.080.889</b>   | <b>1,41</b>                       |
| <b>GESAMTNETTOVERMÖGEN</b>                     |         |              | <b>643.595.783</b> | <b>100,00</b>                     |

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Lower Carbon Equity  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl  | Wäh-<br>rung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens | Beschreibung             | Anzahl  | Wäh-<br>rung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |
|---|---------|--------------|-------------------|-----------------------------------|--------------------------|---------|--------------|-------------------|-----------------------------------|
| <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>  |         |              |                   |                                   | <b>FINNLAND</b>          |         |              |                   |                                   |
| <b>AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |         |              |                   |                                   | ELISA                    |         |              |                   |                                   |
| <b>AKTIEN</b>   |         |              |                   |                                   | NOKIA                    |         |              |                   |                                   |
| <b>AUSTRALIEN</b>   |         |              |                   |                                   | OUTOTEC                  |         |              |                   |                                   |
| ARISTOCRAT LEISURE  | 26.537  | AUD          | 744.448           | 0,20                              | UPM-KYMMENE              | 29.845  | EUR          | 994.053           | 0,28                              |
| BLUESCOPE STEEL   | 25.151  | AUD          | 391.343           | 0,11                              |                          |         |              | <b>1.447.363</b>  | <b>0,39</b>                       |
| BRAMBLES  | 71.696  | AUD          | 755.408           | 0,20                              | <b>FRANKREICH</b>        |         |              |                   |                                   |
| FORTESCUE METALS GROUP  | 5.235   | AUD          | 87.774            | 0,02                              | AXA                      | 89.284  | EUR          | 3.355.649         | 0,90                              |
| MIRVAC GROUP  | 67.155  | AUD          | 103.396           | 0,03                              | BOUYGUES                 | 6.766   | EUR          | 277.238           | 0,07                              |
| PILBARA MINERALS  | 161.260 | AUD          | 402.939           | 0,11                              | BUREAU VERITAS           | 870     | EUR          | 26.572            | 0,01                              |
| QBE INSURANCE GROUP   | 71.821  | AUD          | 849.500           | 0,23                              | CREDIT AGRICOLE          | 60.266  | EUR          | 900.678           | 0,24                              |
| SONIC HEALTHCARE  | 25.554  | AUD          | 490.307           | 0,13                              | DANONE                   | 8       | EUR          | 518               | 0,00                              |
| WESTPAC BANKING CORP  | 3.160   | AUD          | 53.807            | 0,01                              | MICHELIN                 | 35.541  | EUR          | 1.363.793         | 0,37                              |
| WOODSIDE ENERGY GROUP   | 107.098 | AUD          | 2.131.056         | 0,57                              | SAINT GOBAIN             | 571     | EUR          | 44.290            | 0,01                              |
|   |         |              | <b>6.009.978</b>  | <b>1,61</b>                       | SOCIETE GENERALE         | 38.737  | EUR          | 1.032.093         | 0,28                              |
|   |         |              |                   |                                   | UNIBAIL RODAMCO          |         |              |                   |                                   |
| <b>ÖSTERREICH</b>   |         |              |                   |                                   | WESTFIELD                | 2.039   | EUR          | 164.014           | 0,04                              |
| VERBUND   | 3.808   | EUR          | 278.837           | 0,08                              |                          |         |              | <b>7.411.965</b>  | <b>1,99</b>                       |
| VOESTALPINE   | 1.725   | EUR          | 48.214            | 0,01                              | <b>DEUTSCHLAND</b>       |         |              |                   |                                   |
|   |         |              | <b>327.051</b>    | <b>0,09</b>                       | ALLIANZ                  | 1.699   | EUR          | 509.466           | 0,14                              |
| <b>BELGIEN</b>  |         |              |                   |                                   | BMW                      | 17.987  | EUR          | 2.076.246         | 0,56                              |
| KBC GROUP   | 14.123  | EUR          | 1.056.106         | 0,28                              | GEA GROUP                | 7.243   | EUR          | 306.405           | 0,08                              |
| WAREHOUSES DE PAUW  | 9.816   | EUR          | 280.298           | 0,08                              | HENKEL                   | 3.378   | EUR          | 243.994           | 0,07                              |
|   |         |              | <b>1.336.404</b>  | <b>0,36</b>                       | LEG IMMOBILIEN GMBH      | 360     | EUR          | 30.840            | 0,01                              |
| <b>KANADA</b>   |         |              |                   |                                   | LUFTHANSA                | 15.699  | EUR          | 123.635           | 0,03                              |
| AGNICO EAGLE MINES  | 609     | CAD          | 36.034            | 0,01                              | MERCK KGAA               | 6.454   | EUR          | 1.141.041         | 0,31                              |
| ARC RESOURCES   | 33.720  | CAD          | 601.266           | 0,16                              | MUENCHENER RUECK         | 171     | EUR          | 83.549            | 0,02                              |
| BANK OF NOVA SCOTIA   | 68.478  | CAD          | 3.548.255         | 0,96                              | SAP                      | 22.919  | EUR          | 4.477.731         | 1,19                              |
| CANADIAN NATIONAL   |         |              |                   |                                   | SIEMENS                  | 1.805   | EUR          | 344.654           | 0,09                              |
| RAILWAY   | 637     | CAD          | 84.485            | 0,02                              | TALANX                   | 2.661   | EUR          | 210.368           | 0,06                              |
| CANADIAN TIRE „A“   | 1.250   | CAD          | 125.356           | 0,03                              |                          |         |              | <b>9.547.929</b>  | <b>2,56</b>                       |
| CGI   | 10.146  | CAD          | 1.120.877         | 0,30                              | <b>GROSSBRITANNIEN</b>   |         |              |                   |                                   |
| IA FINANCIAL  | 3.091   | CAD          | 193.923           | 0,05                              | 3I GROUP                 | 50.743  | GBP          | 1.806.369         | 0,48                              |
| KINROSS GOLD  | 12.618  | CAD          | 76.645            | 0,02                              | ASSOCIATED BRITISH FOODS | 1.062   | GBP          | 33.526            | 0,01                              |
| MANULIFE FINANCIAL CORP   | 101.015 | CAD          | 2.522.296         | 0,68                              | AVIVA                    | 78.924  | GBP          | 494.765           | 0,13                              |
| NATIONAL BANK OF CANADA   | 17.882  | CAD          | 1.515.791         | 0,41                              | BARCLAYS                 | 471.976 | GBP          | 1.096.336         | 0,29                              |
| OPEN TEXT CORP  | 13.895  | CAD          | 543.684           | 0,15                              | BARRATT DEVELOPMENTS     | 29.445  | GBP          | 177.018           | 0,05                              |
| RB GLOBAL   | 115     | CAD          | 8.871             | 0,00                              | BERKELEY GROUP           |         |              |                   |                                   |
| SUN LIFE FINANCIAL  |         |              |                   |                                   | HOLDINGS                 | 3.125   | GBP          | 188.066           | 0,05                              |
| SERVICES  | 31.348  | CAD          | 1.715.598         | 0,46                              | BT GROUP                 | 134.381 | GBP          | 185.884           | 0,05                              |
| WEST FRASER TIMBER  | 1.312   | CAD          | 114.083           | 0,03                              | BUNZL                    | 1.758   | GBP          | 67.801            | 0,02                              |
|   |         |              | <b>12.207.164</b> | <b>3,28</b>                       | HSBC HOLDINGS            | 447.220 | GBP          | 3.508.343         | 0,95                              |
| <b>DÄNEMARK</b>   |         |              |                   |                                   | KINGFISHER               | 102.668 | GBP          | 322.293           | 0,09                              |
| A P MOLLER – MAERSK   | 83      | DKK          | 106.176           | 0,03                              | LAND SECURITIES          | 220     | GBP          | 1.819             | 0,00                              |
| A P MOLLER -  |         |              |                   |                                   | MONDI PLC                | 17.636  | GBP          | 310.342           | 0,08                              |
| MAERSK (DK0010244508)   | 227     | DKK          | 295.611           | 0,08                              | NATIONAL GRID            | 103     | GBP          | 1.385             | 0,00                              |
| NOVO NORDISK  | 26.594  | DKK          | 3.393.512         | 0,91                              | NATWEST GROUP            | 321.780 | GBP          | 1.080.445         | 0,29                              |
| PANDORA   | 3.445   | DKK          | 555.919           | 0,15                              | NEXT                     | 6.712   | GBP          | 784.810           | 0,21                              |
|   |         |              | <b>4.351.218</b>  | <b>1,17</b>                       | REED ELSEVIER            | 79.670  | GBP          | 3.455.078         | 0,93                              |
|   |         |              |                   |                                   | SAINSBURY (J)            | 55.529  | GBP          | 190.098           | 0,05                              |
|   |         |              |                   |                                   | SEGRO REIT               | 4.531   | GBP          | 51.493            | 0,01                              |
|   |         |              |                   |                                   | SMITHS GROUP             | 12.306  | GBP          | 255.103           | 0,07                              |
|   |         |              |                   |                                   | TAYLOR WIMPEY            | 188.941 | GBP          | 327.349           | 0,09                              |
|   |         |              |                   |                                   |                          |         |              | <b>14.338.323</b> | <b>3,85</b>                       |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Lower Carbon Equity (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung            | Anzahl  | Währung | Kurswert          | % des Nettovermögens | Beschreibung           | Anzahl  | Währung | Kurswert         | % des Nettovermögens |
|-------------------------|---------|---------|-------------------|----------------------|------------------------|---------|---------|------------------|----------------------|
| <b>HONGKONG</b>         |         |         |                   |                      | <b>NIEDERLANDE</b>     |         |         |                  |                      |
| BOC HONG KONG HOLDINGS  | 172.748 | HKD     | 462.415           | 0,12                 | AHOLD DELHAIZE         | 11.482  | EUR     | 343.309          | 0,09                 |
| HANG SENG BANK          | 37.400  | HKD     | 409.293           | 0,11                 | ASML HOLDING           | 2.366   | EUR     | 2.284.420        | 0,61                 |
| MTR CORP                | 45.337  | HKD     | 149.454           | 0,04                 | CNH INDUSTRIAL         | 56.448  | USD     | 725.921          | 0,19                 |
|                         |         |         | <b>1.021.162</b>  | <b>0,27</b>          | ING GROEP              | 11.718  | EUR     | 192.869          | 0,05                 |
| <b>IRLAND</b>           |         |         |                   |                      | <b>NEUSEELAND</b>      |         |         |                  |                      |
| ACCENTURE CORP          | 10.399  | USD     | 3.567.377         | 0,96                 | KONINKLIJKE KPN        | 47.598  | EUR     | 178.275          | 0,05                 |
| AIB GROUP               | 64.647  | EUR     | 330.243           | 0,09                 | NN GROUP               | 1.029   | EUR     | 47.609           | 0,01                 |
| CRH                     | 28.578  | GBP     | 2.472.929         | 0,66                 | NXP SEMICONDUCTORS     | 13.533  | USD     | 3.351.178        | 0,91                 |
| DCC                     | 3.261   | GBP     | 237.446           | 0,06                 | ST MICROELECTRONICS    | 38.550  | EUR     | 1.668.066        | 0,45                 |
| KERRY GROUP „A“         | 2.024   | EUR     | 174.305           | 0,05                 | WOLTERS KLUWER CERT    | 9       | EUR     | 1.413            | 0,00                 |
| PENTAIR                 | 8.077   | USD     | 691.714           | 0,19                 |                        |         |         | <b>8.793.060</b> | <b>2,36</b>          |
| TRANE TECHNOLOGIES      | 12.014  | USD     | 3.599.755         | 0,96                 | XERO                   | 2.851   | AUD     | 247.974          | 0,07                 |
|                         |         |         | <b>11.073.769</b> | <b>2,97</b>          |                        |         |         | <b>247.974</b>   | <b>0,07</b>          |
| <b>ITALIEN</b>          |         |         |                   |                      | <b>NORWEGEN</b>        |         |         |                  |                      |
| GENERALI                | 52.496  | EUR     | 1.331.781         | 0,36                 | AKER BP                | 916     | NOK     | 22.781           | 0,01                 |
|                         |         |         | <b>1.331.781</b>  | <b>0,36</b>          | GJENSIDIGE FORSIKRING  | 800     | NOK     | 11.592           | 0,00                 |
| <b>JAPAN</b>            |         |         |                   |                      | <b>PORTUGAL</b>        |         |         |                  |                      |
| ANA HOLDINGS            | 5.713   | JPY     | 119.284           | 0,03                 | GALP ENERGIA „B“       | 26.214  | EUR     | 432.877          | 0,12                 |
| BRIDGESTONE             | 31.882  | JPY     | 1.409.511         | 0,38                 |                        |         |         | <b>432.877</b>   | <b>0,12</b>          |
| BROTHER INDUSTRIES      | 13.085  | JPY     | 241.996           | 0,06                 | <b>SINGAPUR</b>        |         |         |                  |                      |
| FANUC CORP              | 53.284  | JPY     | 1.485.734         | 0,40                 | KEPPEL CORP            | 951     | SGD     | 5.172            | 0,00                 |
| HANKYU                  | 600     | JPY     | 17.174            | 0,00                 |                        |         |         | <b>5.172</b>     | <b>0,00</b>          |
| HITACHI                 | 3.582   | JPY     | 325.550           | 0,09                 | <b>SPANIEN</b>         |         |         |                  |                      |
| HONDA MOTOR             | 214.118 | JPY     | 2.636.419         | 0,72                 | BANCO BILBAO VIZCAYA   | 161.836 | EUR     | 1.931.351        | 0,52                 |
| HOYA                    | 1.777   | JPY     | 221.149           | 0,06                 | BANCO SANTANDER        | 791.293 | EUR     | 3.864.058        | 1,03                 |
| KDDI                    | 80.977  | JPY     | 2.390.599         | 0,64                 | CAIXABANK              | 20.108  | EUR     | 97.877           | 0,03                 |
| MARUBENI                | 76.604  | JPY     | 1.321.317         | 0,35                 | ENAGAS                 | 5.300   | EUR     | 78.762           | 0,02                 |
| MITSUBI                 | 19.233  | JPY     | 895.028           | 0,24                 | ENDESA                 | 17.915  | EUR     | 331.628          | 0,09                 |
| MS & AD INSURANCE GROUP | 450     | JPY     | 7.922             | 0,00                 | RED ELECTRICA          |         |         |                  |                      |
| NIPPON EXPRESS HOLDINGS | 1.598   | JPY     | 81.397            | 0,02                 | CORPORACION            | 4.394   | EUR     | 74.955           | 0,02                 |
| NIPPON YUSEN            | 25.898  | JPY     | 710.144           | 0,19                 |                        |         |         | <b>6.378.631</b> | <b>1,71</b>          |
| NKSJ HOLDINGS           | 47.310  | JPY     | 987.807           | 0,27                 | <b>SCHWEDEN</b>        |         |         |                  |                      |
| OBAYASHI CORP           | 1.630   | JPY     | 19.316            | 0,01                 | SAAB B                 | 1.387   | SEK     | 123.490          | 0,03                 |
| ORIX                    | 65.287  | JPY     | 1.422.687         | 0,38                 | SCA „B“                | 23.151  | SEK     | 355.733          | 0,10                 |
| RESONA                  | 13.500  | JPY     | 83.135            | 0,02                 | VOLVO AB „B“           | 76.671  | SEK     | 2.080.154        | 0,56                 |
| RICOH                   | 30.942  | JPY     | 274.265           | 0,07                 |                        |         |         | <b>2.559.377</b> | <b>0,69</b>          |
| SECOM                   | 8.464   | JPY     | 612.940           | 0,16                 | <b>SCHWEIZ</b>         |         |         |                  |                      |
| SEKISUI HOUSE           | 33.273  | JPY     | 754.960           | 0,20                 | BALOISE HOLDING        | 2.219   | CHF     | 348.112          | 0,09                 |
| SG HOLDINGS             | 18.061  | JPY     | 228.470           | 0,06                 | BUNGE GLOBAL           | 6.508   | USD     | 673.643          | 0,18                 |
| SHIMIZU                 | 2.335   | JPY     | 15.035            | 0,00                 | GEBERIT                | 112     | CHF     | 66.228           | 0,02                 |
| SHIONOGI                | 10.173  | JPY     | 519.791           | 0,14                 | KUEHNE & NAGEL         |         |         |                  |                      |
| SOFTBANK CORP           | 10.100  | JPY     | 129.533           | 0,03                 | INTERNATIONAL          | 2.565   | CHF     | 715.933          | 0,19                 |
| SONY                    | 13.748  | JPY     | 1.174.546         | 0,32                 | LINDT & SPRUENGLI      | 1       | CHF     | 11.968           | 0,00                 |
| TOKIO MARINE HOLDINGS   | 99.667  | JPY     | 3.111.611         | 0,84                 | LOGITECH INTERNATIONAL | 8.913   | CHF     | 799.963          | 0,21                 |
| TOKYO GAS               | 20.850  | JPY     | 473.360           | 0,13                 | SGS                    | 6.633   | CHF     | 644.816          | 0,17                 |
| TOTO                    | 3.139   | JPY     | 87.858            | 0,02                 | SWISS REINSURANCE      | 17.013  | CHF     | 2.193.916        | 0,59                 |
| YAMAHA MOTOR            | 31.100  | JPY     | 285.529           | 0,08                 | SWISSCOM               | 120     | CHF     | 73.436           | 0,02                 |
|                         |         |         | <b>22.044.067</b> | <b>5,91</b>          | TEMENOS GROUP          | 313     | CHF     | 22.400           | 0,01                 |
| <b>JERSEY</b>           |         |         |                   |                      | <b>VAT GROUP</b>       |         |         |                  |                      |
| AMCOR                   | 8.051   | USD     | 76.807            | 0,02                 |                        | 31      | CHF     | 16.011           | 0,00                 |
| FERGUSON NEWCO          | 11.138  | USD     | 2.444.846         | 0,66                 |                        |         |         |                  |                      |
|                         |         |         | <b>2.521.653</b>  | <b>0,68</b>          |                        |         |         |                  |                      |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Lower Carbon Equity (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung                      | Anzahl | Wäh-<br>rung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens | Beschreibung                       | Anzahl | Wäh-<br>rung | Kurswert   | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |
|-----------------------------------|--------|--------------|------------------|-----------------------------------|------------------------------------|--------|--------------|------------|-----------------------------------|
| ZURICH INSURANCE GROUP            | 5.643  | CHF          | 3.046.732        | 0,83                              | FASTENAL                           | 30.372 | USD          | 2.353.830  | 0,63                              |
|                                   |        |              | <b>8.613.158</b> | <b>2,31</b>                       | FORTUNE BRANDS HOME &<br>SECURITY  | 7.112  | USD          | 602.458    | 0,16                              |
| <b>USA</b>                        |        |              |                  |                                   | GARTNER „A“                        | 4.004  | USD          | 1.932.851  | 0,52                              |
| 3M CO                             | 30.730 | USD          | 3.242.937        | 0,87                              | GENERAL ELECTRIC                   | 6.795  | USD          | 1.189.872  | 0,32                              |
| ADOBE SYSTEMS                     | 7.959  | USD          | 4.000.512        | 1,07                              | GENERAL MILLS                      | 30.283 | USD          | 2.125.867  | 0,57                              |
| ALLY FINANCIAL                    | 13.272 | USD          | 536.056          | 0,14                              | GILEAD SCIENCES                    | 50.200 | USD          | 3.694.720  | 0,99                              |
| ALPHABET „A“                      | 31.525 | USD          | 4.743.251        | 1,27                              | GRACO                              | 7.365  | USD          | 692.899    | 0,19                              |
| AMAZON.COM                        | 35.074 | USD          | 6.335.065        | 1,71                              | GRAINGER W W                       | 2.366  | USD          | 2.419.211  | 0,65                              |
| AMERICAN EXPRESS                  | 17.917 | USD          | 4.068.951        | 1,09                              | HALFMOON PARENT                    | 1.008  | USD          | 367.658    | 0,10                              |
| AMERISOURCEBERGEN                 | 8.785  | USD          | 2.115.077        | 0,57                              | HESS                               | 13.613 | USD          | 2.065.228  | 0,55                              |
| AMGEN                             | 5.951  | USD          | 1.703.890        | 0,46                              | HEWLETT PACKARD                    |        |              |            |                                   |
| ANTHEM                            | 7.683  | USD          | 3.999.002        | 1,07                              | ENTERPRISE                         | 70.764 | USD          | 1.261.014  | 0,34                              |
| APA                               | 17.094 | USD          | 585.299          | 0,16                              | HOLOGIC                            | 11.595 | USD          | 898.207    | 0,24                              |
| APPLE                             | 72.299 | USD          | 12.371.081       | 3,33                              | HOMER DEPOT                        | 13.884 | USD          | 5.317.849  | 1,43                              |
| APPLIED MATERIALS                 | 20.217 | USD          | 4.156.413        | 1,12                              | HORMEL FOODS                       | 2.963  | USD          | 103.290    | 0,03                              |
| AUTODESK                          | 11.647 | USD          | 3.046.389        | 0,82                              | HOST MARRIOTT                      | 39.446 | USD          | 809.037    | 0,22                              |
| AUTOMATIC DATA<br>PROCESSING      | 15.661 | USD          | 3.913.841        | 1,05                              | HP                                 | 52.642 | USD          | 1.588.736  | 0,43                              |
| AVALONBAY COMMUNITIES             | 2.460  | USD          | 457.437          | 0,12                              | HUNTINGTON BANCSHARES              | 445    | USD          | 6.183      | 0,00                              |
| BANK OF NEW YORK MELLON           | 39.352 | USD          | 2.268.249        | 0,61                              | IDEXX LABORATORIES                 | 4.644  | USD          | 2.521.042  | 0,68                              |
| BERKSHIRE HATHAWAY „B“            | 10     | USD          | 4.169            | 0,00                              | INTEL                              | 5.540  | USD          | 246.530    | 0,07                              |
| BEST BUY                          | 9.435  | USD          | 779.614          | 0,21                              | INTERNATIONAL BUSINESS<br>MACHINES | 21.455 | USD          | 4.097.261  | 1,10                              |
| BUILDERS FIRSTSOURCE              | 6.957  | USD          | 1.462.083        | 0,39                              | INTUIT                             | 302    | USD          | 197.337    | 0,05                              |
| CAPITAL ONE FINANCIAL             | 21.481 | USD          | 3.194.010        | 0,86                              | J.B. HUNT TRANSPORT<br>SERVICES    | 4.379  | USD          | 874.267    | 0,23                              |
| CARRIER GLOBAL                    | 14.186 | USD          | 821.086          | 0,22                              | KEYSIGHT TECHNOLOGIES              | 6      | USD          | 946        | 0,00                              |
| CBRE GROUP                        | 15.967 | USD          | 1.560.615        | 0,42                              | KIMBERLY-CLARK                     | 17.649 | USD          | 2.278.839  | 0,61                              |
| CENTENE                           | 30.131 | USD          | 2.364.982        | 0,63                              | KROGER                             | 37.701 | USD          | 2.154.612  | 0,58                              |
| CH ROBINSON WORLDWIDE             | 5.359  | USD          | 405.140          | 0,11                              | LAM RESEARCH                       | 4.196  | USD          | 4.083.170  | 1,10                              |
| CHENIERE ENERGY                   | 13.439 | USD          | 2.156.960        | 0,58                              | LENNOX INTERNATIONAL               | 1.789  | USD          | 873.408    | 0,23                              |
| CHEVRON                           | 774    | USD          | 121.859          | 0,03                              | LKQ                                | 14.406 | USD          | 772.162    | 0,21                              |
| CISCO SYSTEMS                     | 78.792 | USD          | 3.953.783        | 1,06                              | LOWES                              | 3.273  | USD          | 829.575    | 0,22                              |
| CITIGROUP                         | 69     | USD          | 4.349            | 0,00                              | LULULEMON ATHLETICA                | 105    | USD          | 41.305     | 0,01                              |
| COCA-COLA (US1912161007)          | 62.683 | USD          | 3.829.618        | 1,03                              | MICROSOFT                          | 44.257 | USD          | 18.629.983 | 5,01                              |
| COGNIZANT TECHNOLOGY<br>SOLUTIONS | 13.886 | USD          | 1.022.843        | 0,27                              | NETAPP                             | 10.078 | USD          | 1.063.733  | 0,29                              |
| CONOCOPHILLIPS                    | 17.967 | USD          | 2.288.636        | 0,61                              | NUCOR                              | 12.920 | USD          | 2.556.868  | 0,69                              |
| CROWN CASTLE REIT                 | 5.031  | USD          | 533.336          | 0,14                              | NVIDIA                             | 12.330 | USD          | 11.195.023 | 3,01                              |
| CUMMINS                           | 7.617  | USD          | 2.243.130        | 0,60                              | NVR                                | 162    | USD          | 1.317.238  | 0,35                              |
| DAVITA HEALTHCARE<br>PARTNERS     | 1.110  | USD          | 152.947          | 0,04                              | ON SEMICONDUCTOR                   | 265    | USD          | 19.761     | 0,01                              |
| DECKERS OUTDOOR                   | 1.451  | USD          | 1.375.258        | 0,37                              | ONEOK                              | 30.530 | USD          | 2.443.316  | 0,66                              |
| DELL TECHNOLOGIES                 | 12.042 | USD          | 1.376.762        | 0,37                              | OVINTIV                            | 14.623 | USD          | 759.811    | 0,20                              |
| DISCOVER FINANCIAL<br>SERVICES    | 14.104 | USD          | 1.842.406        | 0,49                              | OWENS CORNING                      | 4.864  | USD          | 816.228    | 0,22                              |
| DISCOVERY                         | 1.295  | USD          | 11.299           | 0,00                              | PIONEER NATURAL<br>RESSOURCEN      | 5.678  | USD          | 1.484.286  | 0,40                              |
| DR HORTON                         | 15.761 | USD          | 2.602.141        | 0,70                              | PNC FINANCIAL SERVICES             | 21.047 | USD          | 3.396.144  | 0,91                              |
| EDWARDS LIFESCIENCES              | 19.372 | USD          | 1.839.565        | 0,49                              | POOL                               | 1.726  | USD          | 703.431    | 0,19                              |
| ELECTRONIC ARTS                   | 13.951 | USD          | 1.857.855        | 0,50                              | PRINCIPAL FINANCIAL GROUP          | 11.860 | USD          | 1.023.162  | 0,27                              |
| ELI LILLY                         | 848    | USD          | 667.851          | 0,18                              | PRUDENTIAL FINANCIAL               | 6.856  | USD          | 804.620    | 0,22                              |
| EOG RESOURCES                     | 17.641 | USD          | 2.247.463        | 0,60                              | PUBLIC SERVICE                     |        |              |            |                                   |
| EXPEDITOR INTERNATIONAL           | 8.130  | USD          | 993.080          | 0,27                              | ENTERPRISE GROUP                   | 3.032  | USD          | 202.083    | 0,05                              |
| EXXON MOBIL                       | 291    | USD          | 33.657           | 0,01                              | PUBLIC STORAGE                     | 5.133  | USD          | 1.485.901  | 0,40                              |
| FACEBOOK                          | 6.910  | USD          | 3.369.316        | 0,90                              | PULTE GROUP                        | 10.722 | USD          | 1.293.717  | 0,35                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Lower Carbon Equity (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl  | Wäh-<br>rung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens | Beschreibung   | Anzahl    | Wäh-<br>rung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |
|---|---------|--------------|--------------------|-----------------------------------|--|-----------|--------------|--------------------|-----------------------------------|
| QUEST DIAGNOSTICS   | 5.146   | USD          | 681.176            | 0,18                              | <b>AN EINEM ANDEREM GEREGLTEN MARKT<br/>GEHANDELTE, ÜBERTRAGBARE<br/>WERTPAPIERE</b> |           |              |                    |                                   |
| REGENERON PHARMS  | 2.241   | USD          | 2.165.994          | 0,58                              | <b>AKTIEN</b>  |           |              |                    |                                   |
| REGIONS FINANCIAL   | 52.460  | USD          | 1.097.988          | 0,29                              | <b>FRANKREICH</b>  |           |              |                    |                                   |
| RELIANCE STEEL &<br>ALUMINIUM   | 2.814   | USD          | 947.474            | 0,25                              | REXEL  | 12.721    | EUR          | 344.154            | 0,09                              |
| ROBERT HALF<br>INTERNATIONAL  | 5.723   | USD          | 450.343            | 0,12                              |  |           |              | <b>344.154</b>     | <b>0,09</b>                       |
| SNAP-ON   | 195     | USD          | 57.979             | 0,02                              | <b>GROSSBRITANNIEN</b>   |           |              |                    |                                   |
| STATE STREET  | 1.644   | USD          | 126.983            | 0,03                              | LLOYDS BANK  | 1.362.272 | GBP          | 892.281            | 0,24                              |
| STEEL DYNAMICS  | 7.781   | USD          | 1.153.378          | 0,31                              |  |           |              | <b>892.281</b>     | <b>0,24</b>                       |
| SYNCHRONY FINANCIAL   | 19.429  | USD          | 833.893            | 0,22                              | <b>SCHWEDEN</b>  |           |              |                    |                                   |
| TESLA MOTORS  | 5.878   | USD          | 1.039.583          | 0,28                              | SWEDBANK „A“   | 762       | SEK          | 15.129             | 0,00                              |
| TEXAS INSTRUMENTS   | 23.344  | USD          | 4.075.162          | 1,09                              | TELE2 AB   | 24.543    | SEK          | 201.760            | 0,06                              |
| THE CLOROX  | 6.910   | USD          | 1.052.324          | 0,28                              |  |           |              | <b>216.889</b>     | <b>0,06</b>                       |
| TRACTOR SUPPLY  | 6.004   | USD          | 1.572.688          | 0,42                              | <b>USA</b>   |           |              |                    |                                   |
| TRAVELERS COMPANIES   | 7.598   | USD          | 1.746.704          | 0,47                              | ALPHABET   | 9.798     | USD          | 1.486.454          | 0,40                              |
| TRUIST FINANCIAL  | 1.370   | USD          | 53.204             | 0,01                              | WELLTOWER  | 560       | USD          | 52.114             | 0,01                              |
| ULTA SALON COSMETICS  |         |              |                    |                                   |  |           |              | <b>1.538.568</b>   | <b>0,41</b>                       |
| AND FRAGRANCE   | 2.457   | USD          | 1.278.967          | 0,34                              | <b>SUMME AKTIEN</b>  |           |              | <b>2.991.892</b>   | <b>0,80</b>                       |
| UNITED RENTALS  | 3.585   | USD          | 2.585.072          | 0,69                              | <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN<br/>MARKT GEHANDELTEN ÜBERTRAGBAREN WERTPAPIERE</b>  |           |              | <b>2.991.892</b>   | <b>0,80</b>                       |
| UNITEDHEALTH GP   | 11.855  | USD          | 5.841.550          | 1,57                              | <b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>   |           |              |                    |                                   |
| VALERO ENERGY   | 6.670   | USD          | 1.126.163          | 0,30                              | <b>FRANKREICH</b>  |           |              |                    |                                   |
| VERALTO CORP  | 13.038  | USD          | 1.166.510          | 0,31                              | GECINA   | 2.184     | EUR          | 223.843            | 0,06                              |
| VERIZON COMMUNICATIONS  | 100.151 | USD          | 4.191.319          | 1,12                              |  |           |              | <b>223.843</b>     | <b>0,06</b>                       |
| VIACOMCBS   | 192     | USD          | 2.283              | 0,00                              | <b>SUMME ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>                                       |           |              | <b>223.843</b>     | <b>0,06</b>                       |
| VICI PROPERTIES REIT  | 31.957  | USD          | 949.762            | 0,25                              | <b>SUMME WERTPAPIERANLAGEN</b>   |           |              | <b>367.917.530</b> | <b>98,72</b>                      |
| VISA „A“  | 3.763   | USD          | 1.047.431          | 0,28                              | <b>SONSTIGES NETTOVERMÖGEN</b>   |           |              | <b>4.784.090</b>   | <b>1,28</b>                       |
| WAL MART STORES   | 258     | USD          | 15.606             | 0,00                              | <b>GESAMTNETTOVERMÖGEN</b>   |           |              | <b>372.701.620</b> | <b>100,00</b>                     |
| WALGREENS BOOTS   |         |              |                    |                                   |  |           |              |                    |                                   |
| ALLIANCE  | 1.213   | USD          | 25.813             | 0,01                              |  |           |              |                    |                                   |
| WALT DISNEY   | 470     | USD          | 57.768             | 0,02                              |  |           |              |                    |                                   |
| WESTERN DIGITAL   | 696     | USD          | 47.739             | 0,01                              |  |           |              |                    |                                   |
| WEYERHAEUSER  | 39.266  | USD          | 1.412.398          | 0,38                              |  |           |              |                    |                                   |
| WILLIAMS SONOMA   | 3.407   | USD          | 1.086.833          | 0,29                              |  |           |              |                    |                                   |
| XYLEM INCORPORATED  | 6.890   | USD          | 893.495            | 0,24                              |  |           |              |                    |                                   |
| ZOETIS  | 19.183  | USD          | 3.272.428          | 0,88                              |  |           |              |                    |                                   |
|   |         |              | <b>240.309.942</b> | <b>64,47</b>                      |  |           |              |                    |                                   |
| <b>SUMME AKTIEN</b>   |         |              | <b>363.940.655</b> | <b>97,66</b>                      |  |           |              |                    |                                   |
| <b>VORZUGSAKTIEN</b>  |         |              |                    |                                   |  |           |              |                    |                                   |
| <b>DEUTSCHLAND</b>  |         |              |                    |                                   |  |           |              |                    |                                   |
| HENKEL  | 9.432   | EUR          | 761.140            | 0,20                              |  |           |              |                    |                                   |
|   |         |              | <b>761.140</b>     | <b>0,20</b>                       |  |           |              |                    |                                   |
| <b>SUMME VORZUGSAKTIEN</b>  |         |              | <b>761.140</b>     | <b>0,20</b>                       |  |           |              |                    |                                   |
| <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN<br/>BÖRSE NOTIERTEN WERTPAPIERE<br/>WERTPAPIERE</b> |         |              | <b>364.701.795</b> | <b>97,86</b>                      |  |           |              |                    |                                   |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Sustainable Equity Income  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl  | Wäh-<br>rung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens | Beschreibung                | Anzahl | Wäh-<br>rung | Kurswert | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |
|---|---------|--------------|-------------------|-----------------------------------|-----------------------------|--------|--------------|----------|-----------------------------------|
| <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>  |         |              |                   |                                   | SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS |        |              |          |                                   |
| <b>AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |         |              |                   |                                   | TRANE TECHNOLOGIES          |        |              |          |                                   |
| <b>AKTIEN</b>   |         |              |                   |                                   | <b>ITALIEN</b>              |        |              |          |                                   |
| <b>AUSTRALIEN</b>   |         |              |                   |                                   | GENERALI                    |        |              |          |                                   |
| FORTESCUE METALS GROUP  | 43.396  | AUD          | 727.607           | 0,30                              | <b>JAPAN</b>                |        |              |          |                                   |
| QBE INSURANCE GROUP   | 51.215  | AUD          | 605.772           | 0,25                              | BRIDGESTONE                 |        |              |          |                                   |
| WOODSIDE ENERGY GROUP   | 128.848 | AUD          | 2.563.843         | 1,03                              | HONDA MOTOR                 |        |              |          |                                   |
|   |         |              | <b>3.897.222</b>  | <b>1,58</b>                       | INPEX CORP                  |        |              |          |                                   |
| <b>BELGIEN</b>  |         |              |                   |                                   | ITOCHU                      |        |              |          |                                   |
| KBC GROUP   | 26.618  | EUR          | 1.990.473         | 0,81                              | KDDI                        |        |              |          |                                   |
|   |         |              | <b>1.990.473</b>  | <b>0,81</b>                       | MARUBENI                    |        |              |          |                                   |
| <b>KANADA</b>   |         |              |                   |                                   | NINTENDO                    |        |              |          |                                   |
| BANK OF NOVA SCOTIA   | 45.168  | CAD          | 2.340.425         | 0,95                              | NIPPON YUSEN                |        |              |          |                                   |
| GREAT WEST LIFECO   | 36.530  | CAD          | 1.166.962         | 0,47                              | NKSJ HOLDINGS               |        |              |          |                                   |
| MANULIFE FINANCIAL CORP   | 89.556  | CAD          | 2.236.170         | 0,91                              | SEKISUI HOUSE               |        |              |          |                                   |
| SUN LIFE FINANCIAL SERVICES                                       | 38.444  | CAD          | 2.103.944         | 0,85                              | YAMAHA MOTOR                |        |              |          |                                   |
|   |         |              | <b>7.847.501</b>  | <b>3,18</b>                       | <b>13.398.130</b>           |        |              |          |                                   |
| <b>DÄNEMARK</b>   |         |              |                   |                                   | <b>5,44</b>                 |        |              |          |                                   |
| NOVO NORDISK  | 29.257  | DKK          | 3.733.323         | 1,51                              | <b>JERSEY</b>               |        |              |          |                                   |
|   |         |              | <b>3.733.323</b>  | <b>1,51</b>                       | FERGUSON NEWCO              |        |              |          |                                   |
| <b>FINNLAND</b>   |         |              |                   |                                   | FERGUSON NEWCO              |        |              |          |                                   |
| KESKO UYJ „B“   | 86.489  | EUR          | 1.616.894         | 0,66                              | FERGUSON NEWCO              |        |              |          |                                   |
|   |         |              | <b>1.616.894</b>  | <b>0,66</b>                       | <b>2.546.478</b>            |        |              |          |                                   |
| <b>FRANKREICH</b>   |         |              |                   |                                   | <b>1,03</b>                 |        |              |          |                                   |
| CREDIT AGRICOLE   | 93.754  | EUR          | 1.401.157         | 0,57                              | <b>NIEDERLANDE</b>          |        |              |          |                                   |
| FONCIERE DES REGIONS  | 27.546  | EUR          | 1.414.894         | 0,58                              | ASML HOLDING                |        |              |          |                                   |
| GDF SUEZ  | 7.642   | EUR          | 127.746           | 0,05                              | KONINKLIJKE KPN             |        |              |          |                                   |
| PUBLICIS GROUPE   | 786     | EUR          | 85.822            | 0,03                              | NXP SEMICONDUCTORS          |        |              |          |                                   |
| SOCIETE GENERALE  | 79.648  | EUR          | 2.122.109         | 0,86                              | ST MICROELECTRONICS         |        |              |          |                                   |
|   |         |              | <b>5.151.728</b>  | <b>2,09</b>                       | <b>5.490.796</b>            |        |              |          |                                   |
| <b>DEUTSCHLAND</b>  |         |              |                   |                                   | <b>2,23</b>                 |        |              |          |                                   |
| ALLIANZ   | 7.606   | EUR          | 2.280.750         | 0,93                              | <b>NORWEGEN</b>             |        |              |          |                                   |
|   |         |              | <b>2.280.750</b>  | <b>0,93</b>                       | STATOIL                     |        |              |          |                                   |
| <b>GROSSBRITANNIEN</b>  |         |              |                   |                                   | TELENOR                     |        |              |          |                                   |
| 3I GROUP  | 532     | GBP          | 18.938            | 0,01                              | <b>2.666.802</b>            |        |              |          |                                   |
| AVIVA   | 101.411 | GBP          | 635.733           | 0,26                              | <b>1,08</b>                 |        |              |          |                                   |
| BARRATT DEVELOPMENTS  | 299.994 | GBP          | 1.803.506         | 0,73                              | <b>SPANIEN</b>              |        |              |          |                                   |
| HSBC HOLDINGS   | 314.491 | GBP          | 2.467.113         | 1,01                              | RED ELECTRICA CORPORACION   |        |              |          |                                   |
| NATIONAL GRID   | 30.559  | GBP          | 410.936           | 0,17                              | RED ELECTRICA CORPORACION   |        |              |          |                                   |
| RIO TINTO   | 15.639  | GBP          | 990.169           | 0,40                              | RED ELECTRICA CORPORACION   |        |              |          |                                   |
| SAINSBURY   | 507.537 | GBP          | 1.737.506         | 0,70                              | RED ELECTRICA CORPORACION   |        |              |          |                                   |
| SCHRODERS   | 131.953 | GBP          | 624.919           | 0,25                              | RED ELECTRICA CORPORACION   |        |              |          |                                   |
| TAYLOR WIMPEY   | 927.871 | GBP          | 1.607.580         | 0,65                              | RED ELECTRICA CORPORACION   |        |              |          |                                   |
|   |         |              | <b>10.296.400</b> | <b>4,18</b>                       | <b>97.010</b>               |        |              |          |                                   |
| <b>IRLAND</b>   |         |              |                   |                                   | <b>0,67</b>                 |        |              |          |                                   |
| ACCENTURE CORP  | 6.192   | USD          | 2.124.166         | 0,86                              | <b>SCHWEIZ</b>              |        |              |          |                                   |
| AIB GROUP   | 382.015 | EUR          | 1.951.485         | 0,79                              | KUEHNE & NAGEL              |        |              |          |                                   |
|   |         |              |                   |                                   | INTERNATIONAL               |        |              |          |                                   |
|   |         |              |                   |                                   | NOVARTIS                    |        |              |          |                                   |
|   |         |              |                   |                                   | SWISS REINSURANCE           |        |              |          |                                   |
|   |         |              |                   |                                   | UBS GROUP                   |        |              |          |                                   |
|   |         |              |                   |                                   | <b>5.912.965</b>            |        |              |          |                                   |
|   |         |              |                   |                                   | <b>2,40</b>                 |        |              |          |                                   |
|   |         |              |                   |                                   | <b>USA</b>                  |        |              |          |                                   |
|   |         |              |                   |                                   | 3M CO                       |        |              |          |                                   |
|   |         |              |                   |                                   | ADOBE SYSTEMS               |        |              |          |                                   |
|   |         |              |                   |                                   | ALPHABET „A“                |        |              |          |                                   |
|   |         |              |                   |                                   | AMAZON.COM                  |        |              |          |                                   |
|   |         |              |                   |                                   | AMERICAN TOWER              |        |              |          |                                   |
|   |         |              |                   |                                   | AMERISOURCEBERGEN           |        |              |          |                                   |
|   |         |              |                   |                                   | AMGEN                       |        |              |          |                                   |
|   |         |              |                   |                                   | AMGEN                       |        |              |          |                                   |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Sustainable Equity Income (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung                   | Anzahl  | Wäh-<br>rung | Kurswert   | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens | Beschreibung  | Anzahl  | Wäh-<br>rung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |
|--------------------------------|---------|--------------|------------|-----------------------------------|---|---------|--------------|--------------------|-----------------------------------|
| ANNALY CAPITAL MANAGEMENT      | 104.105 | USD          | 2.038.376  | 0,83                              | PFIZER  | 44.997  | USD          | 1.254.516          | 0,51                              |
| ANTHEM                         | 4.272   | USD          | 2.223.576  | 0,90                              | PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GROUP   | 28.326  | USD          | 1.887.928          | 0,77                              |
| APPLE                          | 45.717  | USD          | 7.822.636  | 3,17                              | QUEST DIAGNOSTICS   | 13.432  | USD          | 1.777.994          | 0,72                              |
| APPLIED MATERIALS              | 13.464  | USD          | 2.768.064  | 1,12                              | REGIONS FINANCIAL   | 84.363  | USD          | 1.765.718          | 0,72                              |
| AXON ENTERPRISE                | 6.092   | USD          | 1.918.736  | 0,78                              | ROBERT HALF INTERNATIONAL   | 22.387  | USD          | 1.761.633          | 0,71                              |
| BAKER HUGHES                   | 18.057  | USD          | 604.910    | 0,25                              | SALESFORCE  | 3.455   | USD          | 1.040.681          | 0,42                              |
| BANK OF NEW YORK MELLON        | 40.292  | USD          | 2.322.431  | 0,94                              | STARBUCKS   | 3.749   | USD          | 342.959            | 0,14                              |
| BEST BUY                       | 28.428  | USD          | 2.349.006  | 0,95                              | STATE STREET  | 1.902   | USD          | 146.910            | 0,06                              |
| BROADCOM CORP                  | 149     | USD          | 197.276    | 0,08                              | STEEL DYNAMICS  | 2.996   | USD          | 444.097            | 0,18                              |
| CBRE GROUP                     | 10.660  | USD          | 1.041.908  | 0,42                              | SYNCHRONY FINANCIAL   | 49.439  | USD          | 2.121.922          | 0,86                              |
| CH ROBINSON WORLDWIDE          | 10.430  | USD          | 788.508    | 0,32                              | TEXAS INSTRUMENTS   | 15.112  | USD          | 2.638.102          | 1,07                              |
| CISCO SYSTEMS                  | 54.550  | USD          | 2.737.319  | 1,11                              | TRACTOR SUPPLY  | 5.871   | USD          | 1.537.850          | 0,62                              |
| COCA-COLA                      | 45.304  | USD          | 2.767.848  | 1,12                              | UNITED PARCEL SERVICES  | 7.605   | USD          | 1.129.495          | 0,46                              |
| CONS EDISON                    | 11.051  | USD          | 997.905    | 0,40                              | UNITEDHEALTH GP   | 259     | USD          | 127.622            | 0,05                              |
| COSTCO WHOLESALE               | 2.439   | USD          | 1.780.421  | 0,72                              | VERIZON COMMUNICATIONS  | 67.854  | USD          | 2.839.690          | 1,15                              |
| DECKERS OUTDOOR                | 2.519   | USD          | 2.387.508  | 0,97                              | VERTIV HOLDINGS   | 27.951  | USD          | 2.302.883          | 0,93                              |
| DELL TECHNOLOGIES              | 1.490   | USD          | 170.352    | 0,07                              | WEYERHAEUSER  | 8.218   | USD          | 295.601            | 0,12                              |
| DOW                            | 36.304  | USD          | 2.103.454  | 0,85                              | WILLIAMS SONOMA   | 6.555   | USD          | 2.091.045          | 0,85                              |
| ELI LILLY                      | 5.450   | USD          | 4.292.202  | 1,74                              | ZOETIS  | 9.142   | USD          | 1.559.534          | 0,63                              |
| EXPEDITOR INTERNATIONAL        | 16.572  | USD          | 2.024.270  | 0,82                              |   |         |              | <b>156.210.910</b> | <b>63,37</b>                      |
| FASTENAL                       | 27.256  | USD          | 2.112.340  | 0,86                              | <b>SUMME AKTIEN</b>   |         |              | <b>236.049.173</b> | <b>95,77</b>                      |
| FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY | 10.973  | USD          | 929.523    | 0,38                              | <b>VORZUGSAKTIEN</b>  |         |              |                    |                                   |
| GENERAL MILLS                  | 28.977  | USD          | 2.034.185  | 0,83                              | <b>DEUTSCHLAND</b>  |         |              |                    |                                   |
| GILEAD SCIENCES                | 33.726  | USD          | 2.482.234  | 1,01                              | BMW   | 8.013   | EUR          | 861.510            | 0,35                              |
| GOLDMAN SACHS GROUP            | 905     | USD          | 377.204    | 0,15                              |   |         |              | <b>861.510</b>     | <b>0,35</b>                       |
| GRAINGER W W                   | 2.329   | USD          | 2.381.379  | 0,97                              | <b>SUMME VORZUGSAKTIEN</b>  |         |              | <b>861.510</b>     | <b>0,35</b>                       |
| HALFMOON PARENT                | 6.656   | USD          | 2.427.709  | 0,98                              | <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTEN WERTPAPIERE</b>                 |         |              | <b>236.910.683</b> | <b>96,12</b>                      |
| HASBRO                         | 23.045  | USD          | 1.298.355  | 0,53                              | <b>WERTPAPIERE</b>  |         |              |                    |                                   |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRISE     | 59.837  | USD          | 1.066.295  | 0,43                              | <b>AN EINEM ANDEREM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE, ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>    |         |              |                    |                                   |
| HOME DEPOT                     | 9.151   | USD          | 3.505.016  | 1,42                              | <b>AKTIEN</b>   |         |              |                    |                                   |
| HP                             | 71.663  | USD          | 2.162.789  | 0,88                              | <b>ITALIEN</b>  |         |              |                    |                                   |
| HUBSPOT                        | 1.983   | USD          | 1.234.675  | 0,50                              | INTESA BCI  | 198.952 | EUR          | 722.387            | 0,29                              |
| INTEL                          | 25.055  | USD          | 1.114.948  | 0,45                              |   |         |              | <b>722.387</b>     | <b>0,29</b>                       |
| INTERPUBLIC GROUP              | 51.259  | USD          | 1.685.909  | 0,68                              | <b>USA</b>  |         |              |                    |                                   |
| INTUIT                         | 427     | USD          | 279.017    | 0,11                              | ALPHABET  | 18.407  | USD          | 2.792.526          | 1,14                              |
| JOHNSON & JOHNSON              | 1.065   | USD          | 168.824    | 0,07                              | WELLTOWER   | 23.073  | USD          | 2.147.173          | 0,87                              |
| KELLOGG                        | 35.051  | USD          | 2.006.670  | 0,81                              |   |         |              | <b>4.939.699</b>   | <b>2,01</b>                       |
| KIMBERLY-CLARK                 | 13.772  | USD          | 1.778.241  | 0,72                              | <b>SUMME AKTIEN</b>   |         |              | <b>5.662.086</b>   | <b>2,30</b>                       |
| LAM RESEARCH                   | 2.725   | USD          | 2.651.725  | 1,08                              | <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN MARKT GEHANDELTEN ÜBERTRAGBAREN WERTPAPIERE</b> |         |              | <b>5.662.086</b>   | <b>2,30</b>                       |
| LENNOX INTERNATIONAL           | 4.719   | USD          | 2.303.863  | 0,93                              |   |         |              |                    |                                   |
| LYONDELL BASELL INDUSTRIES     | 22.408  | USD          | 2.299.733  | 0,93                              |   |         |              |                    |                                   |
| MCKESSON HBOC                  | 591     | USD          | 317.869    | 0,13                              |   |         |              |                    |                                   |
| MERCK & CO                     | 25.014  | USD          | 3.296.595  | 1,34                              |   |         |              |                    |                                   |
| MICROSOFT                      | 33.708  | USD          | 14.189.382 | 5,77                              |   |         |              |                    |                                   |
| MONGODB                        | 547     | USD          | 198.205    | 0,08                              |   |         |              |                    |                                   |
| NVIDIA                         | 11.679  | USD          | 10.603.948 | 4,31                              |   |         |              |                    |                                   |
| OMNICOM                        | 17.532  | USD          | 1.704.461  | 0,69                              |   |         |              |                    |                                   |
| ONEOK                          | 13.609  | USD          | 1.089.128  | 0,44                              |   |         |              |                    |                                   |
| OWENS CORNING                  | 6.325   | USD          | 1.061.398  | 0,43                              |   |         |              |                    |                                   |
| PEPSICO                        | 14.658  | USD          | 2.571.453  | 1,04                              |   |         |              |                    |                                   |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Sustainable Equity Income (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung   | Anzahl  | Wäh-<br>rung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |
|--|---------|--------------|--------------------|-----------------------------------|
| <b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>                   |         |              |                    |                                   |
| <b>AUSTRALIEN</b>  |         |              |                    |                                   |
| STOCKLAND TRUST  | 611.402 | AUD          | 1.934.561          | 0,78                              |
|  |         |              | <u>1.934.561</u>   | <u>0,78</u>                       |
| <b>SUMME ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>             |         |              | <u>1.934.561</u>   | <u>0,78</u>                       |
| <b>SUMME WERTPAPIERANLAGEN</b>                             |         |              | <u>244.507.330</u> | <u>99,20</u>                      |
| <b>SONSTIGES NETTOVERMÖGEN ABZÜGLICH VERBINDLICHKEITEN</b> |         |              | <u>1.966.101</u>   | <u>0,80</u>                       |
| <b>GESAMTNETTOVERMÖGEN</b>                                 |         |              | <u>246.473.431</u> | <u>100,00</u>                     |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Sustainable Long Term Dividend  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl  | Wäh-<br>rung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens | Beschreibung  | Anzahl | Wäh-<br>rung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |
|---|---------|--------------|------------------|-----------------------------------|---|--------|--------------|-------------------|-----------------------------------|
| <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>  |         |              |                  |                                   | VISA „A“  | 7.870  | USD          | 2.190.615         | 4,55                              |
| <b>AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |         |              |                  |                                   |   |        |              | <b>17.924.067</b> | <b>37,19</b>                      |
| <b>AKTIEN</b>   |         |              |                  |                                   | <b>SUMME AKTIEN</b>   |        |              | <b>47.430.350</b> | <b>98,41</b>                      |
| <b>AUSTRALIEN</b>   |         |              |                  |                                   | <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTEN WERTPAPIERE WERTPAPIERE</b> |        |              | <b>47.430.350</b> | <b>98,41</b>                      |
| CSL   | 8.544   | AUD          | 1.604.896        | 3,33                              | <b>SUMME WERTPAPIERANLAGEN</b>  |        |              | <b>47.430.350</b> | <b>98,41</b>                      |
|   |         |              | <b>1.604.896</b> | <b>3,33</b>                       | <b>SONSTIGES NETTOVERMÖGEN</b>  |        |              | <b>766.504</b>    | <b>1,59</b>                       |
| <b>DÄNEMARK</b>   |         |              |                  |                                   | <b>GESAMTNETTOVERMÖGEN</b>  |        |              | <b>48.196.854</b> | <b>100,00</b>                     |
| COLOPLAST „B“   | 21.209  | DKK          | 2.863.284        | 5,94                              |   |        |              |                   |                                   |
| NOVO NORDISK  | 14.021  | DKK          | 1.789.142        | 3,71                              |   |        |              |                   |                                   |
|   |         |              | <b>4.652.426</b> | <b>9,65</b>                       |   |        |              |                   |                                   |
| <b>FINNLAND</b>   |         |              |                  |                                   |   |        |              |                   |                                   |
| KONE „B“  | 44.227  | EUR          | 2.059.156        | 4,27                              |   |        |              |                   |                                   |
|   |         |              | <b>2.059.156</b> | <b>4,27</b>                       |   |        |              |                   |                                   |
| <b>FRANKREICH</b>   |         |              |                  |                                   |   |        |              |                   |                                   |
| AIR LIQUIDE   | 5.164   | EUR          | 1.075.046        | 2,23                              |   |        |              |                   |                                   |
| ESSILOR INTERNATIONAL   | 7.770   | EUR          | 1.756.361        | 3,65                              |   |        |              |                   |                                   |
| L'OREAL   | 2.949   | EUR          | 1.398.976        | 2,90                              |   |        |              |                   |                                   |
|   |         |              | <b>4.230.383</b> | <b>8,78</b>                       |   |        |              |                   |                                   |
| <b>GROSSBRITANNIEN</b>  |         |              |                  |                                   |   |        |              |                   |                                   |
| REED ELSEVIER   | 33.298  | GBP          | 1.444.047        | 3,00                              |   |        |              |                   |                                   |
|   |         |              | <b>1.444.047</b> | <b>3,00</b>                       |   |        |              |                   |                                   |
| <b>ITALIEN</b>  |         |              |                  |                                   |   |        |              |                   |                                   |
| RECORDATI   | 39.110  | EUR          | 2.159.247        | 4,48                              |   |        |              |                   |                                   |
| TERNA   | 153.546 | EUR          | 1.272.245        | 2,64                              |   |        |              |                   |                                   |
|   |         |              | <b>3.431.492</b> | <b>7,12</b>                       |   |        |              |                   |                                   |
| <b>JAPAN</b>  |         |              |                  |                                   |   |        |              |                   |                                   |
| NINTENDO  | 39.000  | JPY          | 2.128.257        | 4,42                              |   |        |              |                   |                                   |
|   |         |              | <b>2.128.257</b> | <b>4,42</b>                       |   |        |              |                   |                                   |
| <b>NIEDERLANDE</b>  |         |              |                  |                                   |   |        |              |                   |                                   |
| ASML HOLDING  | 4.613   | EUR          | 4.453.943        | 9,24                              |   |        |              |                   |                                   |
| UNILEVER  | 24.628  | GBP          | 1.237.142        | 2,57                              |   |        |              |                   |                                   |
|   |         |              | <b>5.691.085</b> | <b>11,81</b>                      |   |        |              |                   |                                   |
| <b>SPANIEN</b>  |         |              |                  |                                   |   |        |              |                   |                                   |
| AMADEUS IT HOLDINGS „A“   | 30.176  | EUR          | 1.943.672        | 4,03                              |   |        |              |                   |                                   |
| RED ELECTRICA CORPORACION   | 46.967  | EUR          | 801.191          | 1,66                              |   |        |              |                   |                                   |
|   |         |              | <b>2.744.863</b> | <b>5,69</b>                       |   |        |              |                   |                                   |
| <b>SCHWEIZ</b>  |         |              |                  |                                   |   |        |              |                   |                                   |
| GIVAUDAN „N“  | 341     | CHF          | 1.519.678        | 3,15                              |   |        |              |                   |                                   |
|   |         |              | <b>1.519.678</b> | <b>3,15</b>                       |   |        |              |                   |                                   |
| <b>USA</b>  |         |              |                  |                                   |   |        |              |                   |                                   |
| AUTOMATIC DATA PROCESSING   | 10.037  | USD          | 2.508.347        | 5,20                              |   |        |              |                   |                                   |
| COLGATE-PALMOLIVE   | 21.798  | USD          | 1.960.294        | 4,07                              |   |        |              |                   |                                   |
| ECOLAB  | 4.532   | USD          | 1.043.448        | 2,16                              |   |        |              |                   |                                   |
| HOME DEPOT  | 5.136   | USD          | 1.967.191        | 4,08                              |   |        |              |                   |                                   |
| INTUIT  | 4.358   | USD          | 2.847.670        | 5,91                              |   |        |              |                   |                                   |
| MICROSOFT   | 7.221   | USD          | 3.039.679        | 6,31                              |   |        |              |                   |                                   |
| PEPSICO   | 9.349   | USD          | 1.640.095        | 3,40                              |   |        |              |                   |                                   |
| THE CLOROX  | 4.772   | USD          | 726.728          | 1,51                              |   |        |              |                   |                                   |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Sustainable Long Term Equity  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl | Wäh-<br>rung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens | Beschreibung  | Anzahl | Wäh-<br>rung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |
|---|--------|--------------|-------------------|-----------------------------------|---|--------|--------------|--------------------|-----------------------------------|
| <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>  |        |              |                   |                                   | ZOETIS  | 23.792 | USD          | 4.058.677          | 3,74                              |
| <b>AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |        |              |                   |                                   |   |        |              | <b>68.746.974</b>  | <b>63,28</b>                      |
| <b>AKTIEN</b>   |        |              |                   |                                   |   |        |              | <b>106.984.687</b> | <b>98,48</b>                      |
| <b>AUSTRALIEN</b>   |        |              |                   |                                   | <b>SUMME AKTIEN</b>   |        |              |                    |                                   |
| CSL   | 13.095 | AUD          | 2.459.752         | 2,26                              | <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTEN WERTPAPIERE WERTPAPIERE</b> |        |              |                    |                                   |
|   |        |              | <b>2.459.752</b>  | <b>2,26</b>                       |   |        |              | <b>106.984.687</b> | <b>98,48</b>                      |
| <b>DÄNEMARK</b>   |        |              |                   |                                   | <b>SUMME WERTPAPIERANLAGEN</b>  |        |              |                    |                                   |
| COLOPLAST „B“   | 29.190 | DKK          | 3.940.745         | 3,63                              | <b>SONSTIGES NETTOVERMÖGEN</b>  |        |              |                    |                                   |
| NOVO NORDISK  | 40.033 | DKK          | 5.108.388         | 4,70                              |   |        |              | <b>1.649.150</b>   | <b>1,52</b>                       |
|   |        |              | <b>9.049.133</b>  | <b>8,33</b>                       | <b>GESAMTNETTOVERMÖGEN</b>  |        |              |                    |                                   |
| <b>FINNLAND</b>   |        |              |                   |                                   |   |        |              | <b>108.633.837</b> | <b>100,00</b>                     |
| KONE „B“  | 34.515 | EUR          | 1.606.977         | 1,48                              |   |        |              |                    |                                   |
|   |        |              | <b>1.606.977</b>  | <b>1,48</b>                       |   |        |              |                    |                                   |
| <b>FRANKREICH</b>   |        |              |                   |                                   |   |        |              |                    |                                   |
| AIR LIQUIDE   | 1.922  | EUR          | 400.123           | 0,37                              |   |        |              |                    |                                   |
| L'OREAL   | 8.610  | EUR          | 4.084.498         | 3,76                              |   |        |              |                    |                                   |
|   |        |              | <b>4.484.621</b>  | <b>4,13</b>                       |   |        |              |                    |                                   |
| <b>JAPAN</b>  |        |              |                   |                                   |   |        |              |                    |                                   |
| KEYENCE   | 5.800  | JPY          | 2.686.061         | 2,48                              |   |        |              |                    |                                   |
| NINTENDO  | 19.800 | JPY          | 1.080.500         | 0,99                              |   |        |              |                    |                                   |
|   |        |              | <b>3.766.561</b>  | <b>3,47</b>                       |   |        |              |                    |                                   |
| <b>NIEDERLANDE</b>  |        |              |                   |                                   |   |        |              |                    |                                   |
| ASML HOLDING  | 10.586 | EUR          | 10.220.994        | 9,41                              |   |        |              |                    |                                   |
|   |        |              | <b>10.220.994</b> | <b>9,41</b>                       |   |        |              |                    |                                   |
| <b>SCHWEIZ</b>  |        |              |                   |                                   |   |        |              |                    |                                   |
| ALCON   | 55.333 | CHF          | 4.595.213         | 4,23                              |   |        |              |                    |                                   |
| GIVAUDAN „N“  | 461    | CHF          | 2.054.462         | 1,89                              |   |        |              |                    |                                   |
|   |        |              | <b>6.649.675</b>  | <b>6,12</b>                       |   |        |              |                    |                                   |
| <b>USA</b>  |        |              |                   |                                   |   |        |              |                    |                                   |
| ADOBE SYSTEMS   | 11.022 | USD          | 5.540.098         | 5,10                              |   |        |              |                    |                                   |
| AUTOMATIC DATA PROCESSING   | 17.008 | USD          | 4.250.469         | 3,91                              |   |        |              |                    |                                   |
| COLGATE-PALMOLIVE   | 35.582 | USD          | 3.199.889         | 2,95                              |   |        |              |                    |                                   |
| ECOLAB  | 11.207 | USD          | 2.580.300         | 2,38                              |   |        |              |                    |                                   |
| HOME DEPOT  | 8.909  | USD          | 3.412.325         | 3,14                              |   |        |              |                    |                                   |
| IDEXX LABORATORIES  | 6.373  | USD          | 3.459.647         | 3,18                              |   |        |              |                    |                                   |
| INTUIT  | 10.200 | USD          | 6.665.037         | 6,14                              |   |        |              |                    |                                   |
| METTLER TOLEDO  |        |              |                   |                                   |   |        |              |                    |                                   |
| INTERNATIONAL   | 2.528  | USD          | 3.393.511         | 3,12                              |   |        |              |                    |                                   |
| MICROSOFT   | 23.484 | USD          | 9.885.591         | 9,09                              |   |        |              |                    |                                   |
| MSCI  | 8.915  | USD          | 4.996.590         | 4,60                              |   |        |              |                    |                                   |
| ROLLINS   | 8.860  | USD          | 410.129           | 0,38                              |   |        |              |                    |                                   |
| SHERWIN WILLIAMS  | 9.489  | USD          | 3.294.581         | 3,03                              |   |        |              |                    |                                   |
| TRACTOR SUPPLY  | 12.131 | USD          | 3.177.594         | 2,93                              |   |        |              |                    |                                   |
| VISA „A“  | 21.079 | USD          | 5.867.340         | 5,40                              |   |        |              |                    |                                   |
| WATERS  | 13.238 | USD          | 4.555.196         | 4,19                              |   |        |              |                    |                                   |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Hong Kong Equity  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl     | Wäh-<br>rung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens | Beschreibung                        | Anzahl | Wäh-<br>rung | Kurswert | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |
|---|------------|--------------|-------------------|-----------------------------------|-------------------------------------|--------|--------------|----------|-----------------------------------|
| <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>  |            |              |                   |                                   | <b>GROSSBRITANNIEN</b>              |        |              |          |                                   |
| <b>AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |            |              |                   |                                   | HSBC HOLDINGS                       |        |              |          |                                   |
| <b>AKTIEN</b>   |            |              |                   |                                   | 1.482.400 HKD 11.582.360 9,24       |        |              |          |                                   |
| <b>CHINA</b>  |            |              |                   |                                   | <b>11.582.360 9,24</b>              |        |              |          |                                   |
| AGRICULTURAL BANK OF CHINA „H“                                    | 4.140.000  | HKD          | 1.745.619         | 1,39                              | <b>HONGKONG</b>                     |        |              |          |                                   |
| ALIBABA GROUP HOLDING   | 1.194.800  | HKD          | 10.724.492        | 8,55                              | AIA GROUP                           |        |              |          |                                   |
| BAIDU   | 135.300    | HKD          | 1.775.429         | 1,42                              | 728.400 HKD 4.890.777 3,90          |        |              |          |                                   |
| BYD „H“   | 31.000     | HKD          | 798.523           | 0,64                              | 34.838 HKD 423.320 0,34             |        |              |          |                                   |
| CHINA COMMUNICATIONS CONSTRUCTION „H“                             | 2.845.000  | HKD          | 1.341.355         | 1,07                              | 639.500 HKD 5.466.407 4,35          |        |              |          |                                   |
| CHINA CONSTRUCTION BANK „H“                                       | 15.366.680 | HKD          | 9.267.386         | 7,39                              | CHINA RESOURCES ENTERPRISES         |        |              |          |                                   |
| CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP                                  | 234.000    | HKD          | 277.459           | 0,22                              | 156.000 HKD 718.563 0,57            |        |              |          |                                   |
| CHINA MERCHANTS BANK „H“  | 291.000    | HKD          | 1.150.771         | 0,92                              | 177.000 HKD 854.870 0,68            |        |              |          |                                   |
| CHINA MOLYBDENUM  | 2.829.000  | HKD          | 2.403.753         | 1,92                              | CK HUTCHISON HOLDINGS               |        |              |          |                                   |
| CHINA RESOURCES LAND  | 301.000    | HKD          | 951.868           | 0,76                              | CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS          |        |              |          |                                   |
| CHINA TELECOM CORP „H“  | 2.770.000  | HKD          | 1.482.958         | 1,18                              | 402.000 HKD 2.352.484 1,88          |        |              |          |                                   |
| CHINASOFT INTERNATIONAL   | 176.000    | HKD          | 106.143           | 0,08                              | 2.255.000 HKD 5.220.834 4,15        |        |              |          |                                   |
| CITIC SECURITIES „H“  | 524.500    | HKD          | 864.511           | 0,69                              | CNOOC GALAXY ENTERTAINMENT GROUP    |        |              |          |                                   |
| ENN ENERGY HOLDINGS   | 59.000     | HKD          | 454.574           | 0,36                              | 159.000 HKD 798.408 0,64            |        |              |          |                                   |
| HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING                                    | 289.000    | HKD          | 652.114           | 0,52                              | 26.500 HKD 771.320 0,62             |        |              |          |                                   |
| INNOVENT BIOLOGICS  | 216.500    | HKD          | 1.042.880         | 0,83                              | 646.000 HKD 748.643 0,60            |        |              |          |                                   |
| KUAISHOU TECHNOLOGY   | 206.800    | HKD          | 1.296.059         | 1,03                              | POWER ASSETS HOLDINGS               |        |              |          |                                   |
| LI AUTO   | 45.400     | HKD          | 703.642           | 0,56                              | 723.000 HKD 4.230.960 3,37          |        |              |          |                                   |
| MEITUAN DIANPING  | 73.100     | HKD          | 904.124           | 0,72                              | 107.500 HKD 884.565 0,71            |        |              |          |                                   |
| NAURA TECHNOLOGY GROUP  | 14.800     | CNY          | 628.024           | 0,50                              | 409.600 HKD 860.393 0,69            |        |              |          |                                   |
| NETEASE   | 290.915    | HKD          | 6.051.398         | 4,83                              | 105.500 HKD 1.430.221 1,14          |        |              |          |                                   |
| PING AN INSURANCE „H“   | 277.000    | HKD          | 1.169.732         | 0,93                              | 733.600 HKD 3.154.130 2,52          |        |              |          |                                   |
| SHENZOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS                              | 18.200     | HKD          | 172.316           | 0,14                              | <b>32.805.895 26,16</b>             |        |              |          |                                   |
| SUNNY OPTICAL   | 35.800     | HKD          | 182.741           | 0,15                              | <b>LUXEMBURG</b>                    |        |              |          |                                   |
| TECHNOLOGY GROUP  | 311.800    | HKD          | 12.103.167        | 9,66                              | SAMSONITE INTERNATIONAL             |        |              |          |                                   |
| TENCENT HOLDINGS  | 55.850     | HKD          | 2.463.367         | 1,96                              | 168.000 HKD 635.384 0,51            |        |              |          |                                   |
| TRIP COM GROUP  | 26.000     | HKD          | 178.727           | 0,14                              | <b>635.384 0,51</b>                 |        |              |          |                                   |
| TSINGTAO BREWERY „H“  | 676.000    | HKD          | 1.288.697         | 1,03                              | <b>TAIWAN</b>                       |        |              |          |                                   |
| WEICHAI POWER „H“   | 140.000    | HKD          | 255.799           | 0,20                              | MEDIATEK                            |        |              |          |                                   |
| WUXI BIOLOGICS  | 581        | HKD          | -                 | 0,00                              | 7.000 TWD 253.722 0,20              |        |              |          |                                   |
| WUXI BIOLOGICS CAYMAN RIGHTS                                      | 997.400    | HKD          | 1.903.948         | 1,52                              | TAIWAN SEMICONDUCTOR                |        |              |          |                                   |
| XIAOMI  | 34.500     | CNY          | 738.408           | 0,59                              | 265.000 TWD 6.367.585 5,08          |        |              |          |                                   |
| ZHONGJI INNOLIGHT   | 604.000    | HKD          | 1.205.461         | 0,96                              | VERARBEITENDES GEWERBE              |        |              |          |                                   |
| ZIJIN MINING GROUP „H“  | 227.600    | HKD          | 453.662           | 0,36                              | 265.000 TWD 6.367.585 5,08          |        |              |          |                                   |
| ZTE „H“   | 227.600    | HKD          | 453.662           | 0,36                              | <b>6.621.307 5,28</b>               |        |              |          |                                   |
|   |            |              | <b>66.739.107</b> | <b>53,22</b>                      | <b>118.384.053 94,41</b>            |        |              |          |                                   |
|   |            |              |                   |                                   | <b>SUMME AKTIEN</b>                 |        |              |          |                                   |
|   |            |              |                   |                                   | <b>118.384.053 94,41</b>            |        |              |          |                                   |
|   |            |              |                   |                                   | <b>DEPOSITARY RECEIPTS</b>          |        |              |          |                                   |
|   |            |              |                   |                                   | <b>CHINA</b>                        |        |              |          |                                   |
|   |            |              |                   |                                   | TENCENT MUSIC                       |        |              |          |                                   |
|   |            |              |                   |                                   | ENTERTAINMENT GROUP                 |        |              |          |                                   |
|   |            |              |                   |                                   | 21.509 USD 242.837 0,19             |        |              |          |                                   |
|   |            |              |                   |                                   | TRIP COM                            |        |              |          |                                   |
|   |            |              |                   |                                   | 10.965 USD 485.859 0,39             |        |              |          |                                   |
|   |            |              |                   |                                   | <b>728.696 0,58</b>                 |        |              |          |                                   |
|   |            |              |                   |                                   | <b>728.696 0,58</b>                 |        |              |          |                                   |
|   |            |              |                   |                                   | <b>SUMME DEPOSITARY RECEIPTS</b>    |        |              |          |                                   |
|   |            |              |                   |                                   | <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN</b> |        |              |          |                                   |
|   |            |              |                   |                                   | <b>BÖRSE NOTIERTEN WERTPAPIERE</b>  |        |              |          |                                   |
|   |            |              |                   |                                   | <b>119.112.749 94,99</b>            |        |              |          |                                   |
|   |            |              |                   |                                   | <b>WERTPAPIERE</b>                  |        |              |          |                                   |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Hong Kong Equity (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung   | Anzahl  | Wäh-<br>rung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |
|--|---------|--------------|--------------------|-----------------------------------|
| <b>AN EINEM ANDEREM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE,<br/>ÜBERTRAGBARE<br/>WERTPAPIERE</b> |         |              |                    |                                   |
| <b>AKTIEN</b>  |         |              |                    |                                   |
| <b>CHINA</b>   |         |              |                    |                                   |
| NEW ORIENTAL EDUCATION<br>AND TECHNOLOGY   | 305.600 | HKD          | 2.661.058          | 2,12                              |
|  |         |              | <u>2.661.058</u>   | <u>2,12</u>                       |
| <b>SUMME AKTIEN</b>  |         |              | <u>2.661.058</u>   | <u>2,12</u>                       |
| <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN<br/>MARKT GEHANDELTEN ÜBERTRAGBAREN WERTPAPIERE</b>  |         |              | <u>2.661.058</u>   | <u>2,12</u>                       |
| <b>SUMME WERTPAPIERANLAGEN</b>   |         |              | <u>121.773.807</u> | <u>97,11</u>                      |
| <b>SONSTIGES NETTOVERMÖGEN ABZÜGLICH VERBINDLICHKEITEN</b>                           |         |              | <u>3.623.007</u>   | <u>2,89</u>                       |
| <b>GESAMTNETTOVERMÖGEN</b>   |         |              | <u>125.396.814</u> | <u>100,00</u>                     |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

BRIC Equity  
Aufstellung der Wertpapiieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl    | Wäh-<br>rung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens | Beschreibung  | Anzahl    | Wäh-<br>rung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |
|---|-----------|--------------|-------------------|-----------------------------------|---|-----------|--------------|-------------------|-----------------------------------|
| <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>  |           |              |                   |                                   | STATE BANK OF INDIA   |           |              |                   |                                   |
| <b>AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |           |              |                   |                                   | TATA CONSULTANCY SERVICE  |           |              |                   |                                   |
| <b>AKTIEN</b>   |           |              |                   |                                   | ZOMATO  |           |              |                   |                                   |
| <b>BRASILIEN</b>  |           |              |                   |                                   | <b>SUMME AKTIEN</b>   |           |              |                   |                                   |
| B3 SA BRASIL BOLSA BALCAO   | 665.400   | BRL          | 1.596.519         | 1,57                              |   |           |              | <b>30.261.310</b> | <b>29,83</b>                      |
| CENTRAIS ELECTRICAS BRASILEIRAS                                   | 174.200   | BRL          | 1.449.129         | 1,43                              |   |           |              | <b>76.909.670</b> | <b>75,80</b>                      |
| HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS                             | 1.271.888 | BRL          | 955.399           | 0,94                              | <b>DEPOSITARY RECEIPTS</b>  |           |              |                   |                                   |
| LOCALIZA RENT A CAR   | 187.000   | BRL          | 2.055.840         | 2,03                              | <b>BRASILIEN</b>  |           |              |                   |                                   |
| LOJAS RENNER  | 473.200   | BRL          | 1.604.260         | 1,58                              | VALE  |           |              |                   |                                   |
| NU HOLDINGS   | 114.316   | USD          | 1.370.649         | 1,35                              |   | 351.101   | USD          | 4.253.588         | 4,19                              |
| PETRO RIO   | 75.100    | BRL          | 726.612           | 0,72                              |   |           |              | <b>4.253.588</b>  | <b>4,19</b>                       |
| PETROBRAS   | 99.094    | BRL          | 754.655           | 0,74                              | <b>CHINA</b>  |           |              |                   |                                   |
| TIM SA/BRAZIL   | 181.800   | BRL          | 643.222           | 0,63                              | ALIBABA GROUP HOLDING   |           |              |                   |                                   |
| WEG   | 270.500   | BRL          | 2.076.757         | 2,05                              |   | 11.915    | USD          | 863.242           | 0,85                              |
|   |           |              | <b>13.233.042</b> | <b>13,04</b>                      |   | 16.845    | USD          | 1.781.190         | 1,76                              |
| <b>CHINA</b>  |           |              |                   |                                   |   | 6.613     | USD          | 686.297           | 0,68                              |
| ALIBABA GROUP HOLDING   | 507.452   | HKD          | 4.554.875         | 4,49                              |   |           |              | <b>3.330.729</b>  | <b>3,29</b>                       |
| BYD „H“   | 54.500    | HKD          | 1.403.855         | 1,38                              | <b>INDIEN</b>   |           |              |                   |                                   |
| CHINA CONSTRUCTION BANK „H“                                       | 1.622.000 | HKD          | 978.201           | 0,96                              | INFOSYS   |           |              |                   |                                   |
| CHINA LONGYUAN POWER „H“  | 2.992.000 | HKD          | 2.094.968         | 2,06                              |   | 127.133   | USD          | 2.285.216         | 2,25                              |
| CIMC ENRIC HOLDING  | 2.442.000 | HKD          | 2.483.670         | 2,45                              |   |           |              | <b>2.285.216</b>  | <b>2,25</b>                       |
| CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOLOGY                                   | 87.740    | CNY          | 2.291.757         | 2,26                              | <b>SUMME DEPOSITARY RECEIPTS</b>  |           |              |                   |                                   |
| MEITUAN DIANPING  | 264.170   | HKD          | 3.267.338         | 3,22                              |   |           |              | <b>9.869.533</b>  | <b>9,73</b>                       |
| NARI TECHNOLOGY DEVELOPMENT                                       | 286.250   | CNY          | 954.899           | 0,94                              | <b>VORZUGSAKTIEN</b>  |           |              |                   |                                   |
| NETEASE   | 46.900    | HKD          | 975.579           | 0,96                              | <b>BRASILIEN</b>  |           |              |                   |                                   |
| PING AN INSURANCE „H“   | 505.000   | HKD          | 2.132.544         | 2,10                              | BANCO BRADESCO  |           |              |                   |                                   |
| SHENZHEN MINDRAY BIO MEDICAL ELECTRONICS                          | 46.532    | CNY          | 1.801.997         | 1,78                              |   | 1.093.897 | BRL          | 3.140.374         | 3,10                              |
| TENCENT HOLDINGS  | 142.200   | HKD          | 5.519.789         | 5,45                              | ITAU UNIBANCO BANCO MULTIPLO  |           |              |                   |                                   |
| WEICHAI POWER „H“   | 1.295.000 | HKD          | 2.468.731         | 2,43                              |   | 837.000   | BRL          | 5.785.619         | 5,70                              |
|   |           |              | <b>30.928.203</b> | <b>30,48</b>                      |   | 676.900   | BRL          | 5.041.370         | 4,97                              |
| <b>GROSSBRITANNIEN</b>  |           |              |                   |                                   |   |           |              | <b>13.967.363</b> | <b>13,77</b>                      |
| XINYI SOLAR HOLDINGS  | 3.212.092 | HKD          | 2.487.115         | 2,45                              | <b>SUMME VORZUGSAKTIEN</b>  |           |              |                   |                                   |
|   |           |              | <b>2.487.115</b>  | <b>2,45</b>                       | <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTEN WERTPAPIERE WERTPAPIERE</b> |           |              |                   |                                   |
| <b>INDIEN</b>   |           |              |                   |                                   | <b>100.746.566</b>  |           |              |                   |                                   |
| BANDHAN BANK  | 705.195   | INR          | 1.521.958         | 1,50                              | <b>99,30</b>  |           |              |                   |                                   |
| BHARTI AIRTEL   | 197.023   | INR          | 2.902.341         | 2,86                              | <b>SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>                                    |           |              |                   |                                   |
| HINDUSTAN UNILEVER  | 71.365    | INR          | 1.937.536         | 1,91                              | <b>AKTIEN</b>   |           |              |                   |                                   |
| ICICI BANK  | 134.128   | INR          | 1.758.246         | 1,73                              | <b>NIEDERLANDE</b>  |           |              |                   |                                   |
| INFOSYS   | 98.222    | INR          | 1.764.233         | 1,74                              | YANDEX*   |           |              |                   |                                   |
| MARUTI SUZUKI INDIA   | 19.174    | INR          | 2.896.785         | 2,86                              |   | 71.467    | RUB          | -                 | 0,00                              |
| RELIANCE INDUSTRIES   | 222.356   | INR          | 7.922.727         | 7,81                              |   | 21.591    | USD          | -                 | 0,00                              |
| SHRIRAM TRANSPORT FINANCE   | 120.823   | INR          | 3.418.580         | 3,37                              |   |           |              | -                 | <b>0,00</b>                       |
|   |           |              |                   |                                   | <b>RUSSISCHE FÖDERATION</b>   |           |              |                   |                                   |
|   |           |              |                   |                                   | GAZPROM*  |           |              |                   |                                   |
|   |           |              |                   |                                   |   | 2.815.769 | RUB          | -                 | 0,00                              |
|   |           |              |                   |                                   |   | 30.810    | RUB          | -                 | 0,00                              |
|   |           |              |                   |                                   |   | 438.327   | RUB          | -                 | 0,00                              |
|   |           |              |                   |                                   |   | 1.497.604 | RUB          | -                 | 0,00                              |
|   |           |              |                   |                                   |   |           |              | -                 | <b>0,00</b>                       |
|   |           |              |                   |                                   | <b>SUMME AKTIEN</b>   |           |              |                   |                                   |
|   |           |              |                   |                                   |   |           |              | -                 | <b>0,00</b>                       |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

BRIC Equity (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung                                   | Anzahl | Wäh-<br>rung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |
|--|--------|--------------|--------------------|-----------------------------------|
| <b>DEPOSITARY RECEIPTS</b>                     |        |              |                    |                                   |
| <b>RUSSISCHE FÖDERATION</b>                    |        |              |                    |                                   |
| TCS GROUP HOLDINGS*                            | 44.647 | RUB          | -                  | 0,00                              |
|  |        |              | -                  | <b>0,00</b>                       |
| <b>SUMME DEPOSITARY RECEIPTS</b>               |        |              | -                  | <b>0,00</b>                       |
| <b>SUMME SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |        |              | -                  | <b>0,00</b>                       |
| <b>SUMME WERTPAPIERANLAGEN</b>                 |        |              | <b>100.746.566</b> | <b>99,30</b>                      |
| <b>SONSTIGES NETTOVERMÖGEN</b>                 |        |              | <b>705.845</b>     | <b>0,70</b>                       |
| <b>GESAMTNETTOVERMÖGEN</b>                     |        |              | <b>101.452.411</b> | <b>100,00</b>                     |

\* Aufgrund der Marktgegebenheiten infolge der Ukraine- und Russland-Krise seit dem 25. Februar 2022 haben der Ausschuss für die Preisbestimmung und die Verwaltungsgesellschaft vereinbart und veranlasst, dass alle auf Rubel lautenden russischen Aktien im Anlageportfolio auf null abgeschrieben werden.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

BRIC Markets Equity  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl    | Wäh-<br>rung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens | Beschreibung  | Anzahl  | Wäh-<br>rung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |
|---|-----------|--------------|-------------------|-----------------------------------|---|---------|--------------|-------------------|-----------------------------------|
| <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>  |           |              |                   |                                   | <b>SHRIRAM TRANSPORT<br/>FINANCE</b>  |         |              |                   |                                   |
| <b>AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE<br/>WERTPAPIERE</b> |           |              |                   |                                   | 47.637 INR 1.347.847 3,35   |         |              |                   |                                   |
| <b>AKTIEN</b>   |           |              |                   |                                   | 88.312 INR 796.637 1,98   |         |              |                   |                                   |
| <b>BRASILIEN</b>  |           |              |                   |                                   | SERVICE 13.035 INR 605.828 1,51   |         |              |                   |                                   |
| B3 SA BRASIL BOLSA  |           |              |                   |                                   | ZOMATO  | 450.115 | INR          | 982.776           | 2,45                              |
| BALCAO  | 264.700   | BRL          | 635.104           | 1,58                              |   |         |              | <b>11.417.647</b> | <b>28,41</b>                      |
| CENTRAIS ELECTRICAS<br>BRASILEIRAS                                    | 67.100    | BRL          | 558.189           | 1,39                              |   |         |              | <b>29.705.611</b> | <b>73,91</b>                      |
| HAPVIDA PARTICIPACOES E<br>INVESTIMENTOS                              | 476.422   | BRL          | 357.872           | 0,89                              | <b>SUMME AKTIEN</b>   |         |              |                   |                                   |
| LOCALIZA RENT A CAR   | 73.500    | BRL          | 808.045           | 2,01                              | <b>29.705.611 73,91</b>   |         |              |                   |                                   |
| LOJAS RENNER  | 179.800   | BRL          | 609.565           | 1,52                              | <b>DEPOSITARY RECEIPTS</b>  |         |              |                   |                                   |
| NU HOLDINGS   | 45.015    | USD          | 539.730           | 1,34                              | <b>BRASILIEN</b>  |         |              |                   |                                   |
| PETRO RIO   | 28.200    | BRL          | 272.842           | 0,68                              | VALE 141.152 USD 1.710.056 4,26   |         |              |                   |                                   |
| PETROBRAS   | 40.741    | BRL          | 310.265           | 0,77                              | <b>1.710.056 4,26</b>   |         |              |                   |                                   |
| TIM SA/BRAZIL   | 72.000    | BRL          | 254.741           | 0,63                              | <b>CHINA</b>  |         |              |                   |                                   |
| WEG   | 104.500   | BRL          | 802.296           | 2,00                              | ALIBABA GROUP HOLDING 5.104 USD 369.785 0,92  |         |              |                   |                                   |
|   |           |              | <b>5.148.649</b>  | <b>12,81</b>                      | BAIDU 7.102 USD 750.965 1,87  |         |              |                   |                                   |
| <b>CHINA</b>  |           |              |                   |                                   | NETEASE 2.597 USD 269.517 0,67  |         |              |                   |                                   |
| ALIBABA GROUP HOLDING   | 197.332   | HKD          | 1.771.247         | 4,41                              | <b>1.390.267 3,46</b>   |         |              |                   |                                   |
| BYD „H“   | 22.500    | HKD          | 579.573           | 1,44                              | <b>INDIEN</b>   |         |              |                   |                                   |
| CHINA CONSTRUCTION BANK<br>„H“  | 614.000   | HKD          | 370.293           | 0,92                              | ICICI BANK 17.375 USD 459.395 1,14  |         |              |                   |                                   |
| CHINA LONGYUAN POWER „H“  | 1.163.000 | HKD          | 814.321           | 2,03                              | INFOSYS 53.001 USD 952.693 2,37   |         |              |                   |                                   |
| CIMC ENRIC HOLDING  | 962.000   | HKD          | 978.416           | 2,43                              | <b>1.412.088 3,51</b>   |         |              |                   |                                   |
| CONTEMPORARY AMPEREX<br>TECHNOLOGY                                    | 34.580    | CNY          | 903.225           | 2,25                              | <b>SUMME DEPOSITARY RECEIPTS</b>  |         |              |                   |                                   |
| MEITUAN DIANPING  | 106.320   | HKD          | 1.314.999         | 3,27                              | <b>4.512.411 11,23</b>  |         |              |                   |                                   |
| NARI TECHNOLOGY   |           |              |                   |                                   | <b>VORZUGSAKTIEN</b>  |         |              |                   |                                   |
| DEVELOPMENT   | 107.715   | CNY          | 359.326           | 0,89                              | <b>BRASILIEN</b>  |         |              |                   |                                   |
| NETEASE   | 18.500    | HKD          | 384.823           | 0,96                              | BANCO BRADESCO 431.435 BRL 1.238.569 3,08   |         |              |                   |                                   |
| PING AN INSURANCE „H“   | 198.000   | HKD          | 836.126           | 2,08                              | ITAU UNIBANCO BANCO 332.600 BRL 2.299.040 5,72                                      |         |              |                   |                                   |
| SHENZHEN MINDRAY BIO<br>MEDICAL ELECTRONICS                           | 18.470    | CNY          | 715.269           | 1,78                              | PETROBRAS 263.931 BRL 1.965.688 4,89  |         |              |                   |                                   |
| TENCENT HOLDINGS  | 56.000    | HKD          | 2.173.756         | 5,41                              | <b>5.503.297 13,69</b>  |         |              |                   |                                   |
| WEICHAI POWER „H“   | 510.000   | HKD          | 972.242           | 2,42                              | <b>5.503.297 13,69</b>  |         |              |                   |                                   |
|   |           |              | <b>12.173.616</b> | <b>30,29</b>                      | <b>SUMME VORZUGSAKTIEN</b>  |         |              |                   |                                   |
| <b>GROSSBRITANNIEN</b>  |           |              |                   |                                   | <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN<br/>BÖRSE NOTIERTEN WERTPAPIERE<br/>WERTPAPIERE</b> |         |              |                   |                                   |
| XINYI SOLAR HOLDINGS  | 1.247.194 | HKD          | 965.699           | 2,40                              | <b>39.721.319 98,83</b>   |         |              |                   |                                   |
|   |           |              | <b>965.699</b>    | <b>2,40</b>                       | <b>SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>  |         |              |                   |                                   |
| <b>INDIEN</b>   |           |              |                   |                                   | <b>AKTIEN</b>   |         |              |                   |                                   |
| BANDHAN BANK  | 279.568   | INR          | 603.366           | 1,50                              | <b>NIEDERLANDE</b>  |         |              |                   |                                   |
| BHARTI AIRTEL   | 74.626    | INR          | 1.099.314         | 2,74                              | YANDEX* 7.899 USD - 0,00  |         |              |                   |                                   |
| HINDUSTAN UNILEVER  | 28.032    | INR          | 761.059           | 1,89                              | YANDEX (NL0009805522)* 32.469 RUB - 0,00  |         |              |                   |                                   |
| ICICI BANK  | 18.417    | INR          | 241.423           | 0,60                              | <b>- 0,00</b>   |         |              |                   |                                   |
| INFOSYS   | 39.550    | INR          | 710.385           | 1,77                              | <b>RUSSISCHE FÖDERATION</b>   |         |              |                   |                                   |
| MARUTI SUZUKI INDIA   | 7.581     | INR          | 1.145.328         | 2,85                              | MAGNIT* 13.547 RUB - 0,00   |         |              |                   |                                   |
| RELIANCE INDUSTRIES   | 87.668    | INR          | 3.123.684         | 7,77                              | ROSNEFT OIL* 193.000 RUB - 0,00   |         |              |                   |                                   |
|   |           |              |                   |                                   | SBERBANK* 286.420 RUB - 0,00  |         |              |                   |                                   |
|   |           |              |                   |                                   | <b>- 0,00</b>   |         |              |                   |                                   |
|   |           |              |                   |                                   | <b>SUMME AKTIEN</b>   |         |              |                   |                                   |
|   |           |              |                   |                                   | <b>- 0,00</b>   |         |              |                   |                                   |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

BRIC Markets Equity (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung                                   | Anzahl | Wäh-<br>rung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |
|--|--------|--------------|-------------------|-----------------------------------|
| <b>DEPOSITARY RECEIPTS</b>                     |        |              |                   |                                   |
| <b>RUSSISCHE FÖDERATION</b>                    |        |              |                   |                                   |
| SBERBANK*                                      | 87.128 | USD          | -                 | 0,00                              |
| TCS GROUP HOLDINGS*                            | 19.793 | RUB          | -                 | 0,00                              |
|  |        |              | -                 | <b>0,00</b>                       |
| <b>SUMME DEPOSITARY RECEIPTS</b>               |        |              | -                 | <b>0,00</b>                       |
|  |        |              | -                 | <b>0,00</b>                       |
| <b>SUMME SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |        |              |                   |                                   |
| <b>SUMME WERTPAPIERANLAGEN</b>                 |        |              | <b>39.721.319</b> | <b>98,83</b>                      |
| <b>SONSTIGES NETTOVERMÖGEN</b>                 |        |              | <b>470.592</b>    | <b>1,17</b>                       |
| <b>GESAMTNETTOVERMÖGEN</b>                     |        |              | <b>40.191.911</b> | <b>100,00</b>                     |

\* Aufgrund der Marktgegebenheiten infolge der Ukraine- und Russland-Krise seit dem 25. Februar 2022 haben der Ausschuss für die Preisbestimmung und die Verwaltungsgesellschaft vereinbart und veranlasst, dass alle auf Rubel lautenden russischen Aktien im Anlageportfolio auf null abgeschrieben werden.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Frontier Markets

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl     | Wäh-<br>rung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens | Beschreibung  | Anzahl     | Wäh-<br>rung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |
|---|------------|--------------|-------------------|-----------------------------------|---|------------|--------------|-------------------|-----------------------------------|
| <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>  |            |              |                   |                                   | <b>SSI GROUP</b>                                    |            |              |                   |                                   |
| <b>AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |            |              |                   |                                   | <b>KATAR</b>  |            |              |                   |                                   |
| <b>AKTIEN</b>   |            |              |                   |                                   | <b>RUMÄNIEN</b>                                     |            |              |                   |                                   |
| <b>BANGLADESCH</b>  |            |              |                   |                                   | <b>ROMANIAN BANK</b>                                |            |              |                   |                                   |
| BRAC BANK   | 4.484.901  | BDT          | 1.646.848         | 0,37                              | BANCA TRANSILVANIA                                  | 3.314.651  | RON          | 20.052.344        | 4,44                              |
| SQUARE PHARMACEUTICALS  | 193.148    | BDT          | 382.952           | 0,08                              | BRD-GROUPE SOCIETE GENERALE                         |            |              |                   |                                   |
|   |            |              | <b>2.029.800</b>  | <b>0,45</b>                       | FOR DEVELOPMENT                                     | 302.480    | RON          | 1.413.166         | 0,31                              |
| <b>ÄGYPTEN</b>  |            |              |                   |                                   | <b>OMV PETROM</b>                                   |            |              |                   |                                   |
| EGYPT KUWAIT HOLDING  | 1.643.420  | EGP          | 1.352.181         | 0,30                              |   | 58.081.698 | RON          | 8.456.141         | 1,87                              |
| TALAAAT MOSTAFA GROUP   | 6.140.386  | EGP          | 7.577.029         | 1,67                              |   |            |              | <b>29.921.651</b> | <b>6,62</b>                       |
|   |            |              | <b>8.929.210</b>  | <b>1,97</b>                       | <b>SAUDI-ARABIEN</b>                                |            |              |                   |                                   |
| <b>GROSSBRITANNIEN</b>  |            |              |                   |                                   | <b>ARABIAN CONTRACTING SERVICES</b>                 |            |              |                   |                                   |
| TBC BANK GROUP  | 89.356     | GBP          | 3.617.771         | 0,80                              |   | 171.635    | SAR          | 10.205.201        | 2,26                              |
|   |            |              | <b>3.617.771</b>  | <b>0,80</b>                       | ETIHAD ETISALAT                                     | 242.780    | SAR          | 3.404.940         | 0,75                              |
| <b>GRIECHENLAND</b>   |            |              |                   |                                   | <b>JAHEZ INTERNATIONAL NATIONAL COMMERCIAL BANK</b> |            |              |                   |                                   |
| NATIONAL BANK OF GREECE   | 1.258.646  | EUR          | 9.863.353         | 2,18                              |   | 85.932     | SAR          | 934.816           | 0,21                              |
|   |            |              | <b>9.863.353</b>  | <b>2,18</b>                       | POWER & WATER UTILITY CO FOR JUBAIL & YANBU         | 655.573    | SAR          | 12.113.373        | 2,68                              |
| <b>ISLAND</b>   |            |              |                   |                                   | <b>UNITED INTERNATIONAL TRANSPORTATION</b>          |            |              |                   |                                   |
| ARION BANKI   | 3.999.894  | ISK          | 4.052.490         | 0,90                              |   | 300.807    | SAR          | 6.937.690         | 1,53                              |
| MAREL   | 1.985.253  | ISK          | 6.790.116         | 1,50                              |   |            |              | <b>38.738.813</b> | <b>8,57</b>                       |
|   |            |              | <b>10.842.606</b> | <b>2,40</b>                       | <b>SLOWENIEN</b>                                    |            |              |                   |                                   |
| <b>INDONESIEN</b>   |            |              |                   |                                   | <b>KRKA</b>   |            |              |                   |                                   |
| BANK RAKYAT INDONESIA   | 4.146.800  | IDR          | 1.582.349         | 0,35                              |   | 34.510     | EUR          | 4.789.297         | 1,06                              |
|   |            |              | <b>1.582.349</b>  | <b>0,35</b>                       | NOVA LJUBLJANSKA BANKA                              | 10.303     | EUR          | 1.218.433         | 0,27                              |
| <b>KENIA</b>  |            |              |                   |                                   | <b>VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE</b>                 |            |              |                   |                                   |
| SAFARICOM   | 31.852.044 | KES          | 4.291.262         | 0,95                              | ABU DHABI ISLAMIC BANK                              | 2.631.824  | AED          | 7.826.240         | 1,73                              |
|   |            |              | <b>4.291.262</b>  | <b>0,95</b>                       | ADNOC GAS   | 9.724.048  | AED          | 8.367.734         | 1,85                              |
| <b>KUWAIT</b>   |            |              |                   |                                   | <b>AGTHIA GROUP</b>                                 |            |              |                   |                                   |
| ALI ALGHANIM SONS   |            |              |                   |                                   |   | 1.924.554  | AED          | 3.076.393         | 0,68                              |
| AUTOMOBILINDUSTRIE  | 1.193.039  | KWD          | 4.518.499         | 1,00                              | ALDAR PROPERTIES                                    | 5.592.023  | AED          | 8.405.851         | 1,86                              |
| GULF BANK OF KUWAIT   | 4.263.434  | KWD          | 4.074.934         | 0,90                              | ARAMEX  | 7.000.000  | AED          | 4.670.225         | 1,03                              |
| MOBILE  |            |              |                   |                                   | BURJEEL HOLDINGS                                    | 6.833.739  | AED          | 5.545.597         | 1,23                              |
| TELEKOMMUNIKATION   | 584.688    | KWD          | 933.296           | 0,21                              | DUBAI ELECTRICITY & WATER AUTHORITY                 | 7.597.949  | AED          | 5.069.162         | 1,12                              |
| NATIONAL BANK OF KUWAIT   | 1.407.494  | KWD          | 4.392.699         | 0,97                              | DUBAI TAXI CO PJSC                                  | 13.157.175 | AED          | 8.133.214         | 1,80                              |
|   |            |              | <b>13.919.428</b> | <b>3,08</b>                       | EMAAR DEVELOPMENT                                   | 2.684.042  | AED          | 5.993.449         | 1,33                              |
| <b>MAURITIUS</b>  |            |              |                   |                                   | <b>EMAAR PROPERTIES</b>                             |            |              |                   |                                   |
| MCB GROUP   | 264.842    | MUR          | 2.116.109         | 0,47                              |   | 4.386.547  | AED          | 9.735.406         | 2,14                              |
|   |            |              | <b>2.116.109</b>  | <b>0,47</b>                       | EMIRATES NBD  | 1.142.043  | AED          | 5.380.247         | 1,19                              |
| <b>PERU</b>   |            |              |                   |                                   | <b>PARKIN</b>                                       |            |              |                   |                                   |
| CREDICORP   | 17.763     | USD          | 3.023.884         | 0,67                              |   | 4.500.000  | AED          | 3.541.474         | 0,78                              |
|   |            |              | <b>3.023.884</b>  | <b>0,67</b>                       | TAALEEM HOLDINGS                                    | 3.300.000  | AED          | 3.324.982         | 0,74                              |
| <b>PHILIPPINEN</b>  |            |              |                   |                                   | <b>USA</b>  |            |              |                   |                                   |
| AYALA CORP  | 906.390    | PHP          | 10.319.125        | 2,28                              | LAUREATE EDUCATION                                  | 464.496    | USD          | 6.779.319         | 1,50                              |
| AYALA LAND  | 6.698.000  | PHP          | 3.842.578         | 0,85                              |   |            |              | <b>6.779.319</b>  | <b>1,50</b>                       |
| GLOBE TELECOM   | 17.890     | PHP          | 562.971           | 0,12                              | <b>VIETNAM</b>                                      |            |              |                   |                                   |
| JOLLIBEE FOODS  | 248.660    | PHP          | 1.117.344         | 0,25                              | FPT   | 1.970.979  | VND          | 9.308.394         | 2,06                              |
| METROPOLITAN BANK & TRUST   | 11.488.507 | PHP          | 13.314.529        | 2,94                              | GEMADEPT  | 1.878.950  | VND          | 6.062.351         | 1,34                              |
| PUREGOLD PRICE CLUB   | 9.547.771  | PHP          | 4.551.815         | 1,01                              | MILITARY COMMERCIAL                                 |            |              |                   |                                   |
| ROBINSONS RETAIL HOLDINGS   | 1.410.240  | PHP          | 936.982           | 0,21                              | JOINT STOCK BANK                                    | 3.331.820  | VND          | 3.426.554         | 0,76                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Frontier Markets (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl     | Wäh-<br>rung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens | Beschreibung  | Anzahl     | Wäh-<br>rung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |
|---|------------|--------------|--------------------|-----------------------------------|---|------------|--------------|--------------------|-----------------------------------|
| MOBILE WORLD INVESTMENT   | 3.506.000  | VND          | 7.211.373          | 1,59                              | <b>VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE</b>   |            |              |                    |                                   |
| PETROVIETNAM DRILLING   | 4.203.100  | VND          | 5.458.351          | 1,21                              | ABU DHABI COMMERCIAL  |            |              |                    |                                   |
| PHU NHUAN JEWELRY   | 1.165.900  | VND          | 4.594.008          | 1,02                              | BANK  | 3.116.432  | AED          | 7.128.705          | 1,59                              |
| VIETNAM DAIRY PRODUCTS  | 1.675.694  | VND          | 4.575.297          | 1,01                              | ABU DHABI PORTS   | 2.496.015  | AED          | 3.908.307          | 0,86                              |
| VIETNAM JS COMMERCIAL   |            |              |                    |                                   | AL YAH SATELLITE  |            |              |                    |                                   |
| BANK  | 4.930.390  | VND          | 7.108.749          | 1,57                              | COMMUNICATION   | 6.952.096  | AED          | 4.164.972          | 0,92                              |
| VIETNAM PROSPERITY  | 1.210.774  | VND          | 959.537            | 0,21                              |   |            |              | <b>15.201.984</b>  | <b>3,37</b>                       |
| VIETNAM TECHNOLOGY AND COM-<br>MERCIAL JOINT STCK BANK                              | 1.240.400  | VND          | 2.401.258          | 0,53                              | <b>SUMME AKTIEN</b>   |            |              | <b>18.205.697</b>  | <b>4,03</b>                       |
| VINCOM RETAIL   | 12.553.271 | VND          | 12.986.143         | 2,87                              | <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN<br/>MARKT GEHANDELTEN ÜBERTRAGBAREN<br/>WERTPAPIERE</b> |            |              | <b>18.205.697</b>  | <b>4,03</b>                       |
| VINHOMES JSC  | 2.464.541  | VND          | 4.303.877          | 0,95                              |   |            |              |                    |                                   |
| <b>SUMME AKTIEN</b>   |            |              | <b>68.395.892</b>  | <b>15,12</b>                      | <b>SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>  |            |              |                    |                                   |
|   |            |              | <b>346.836.368</b> | <b>76,70</b>                      | <b>AKTIEN</b>   |            |              |                    |                                   |
| <b>DEPOSITARY RECEIPTS</b>  |            |              |                    |                                   | <b>ÄGYPTEN</b>  |            |              |                    |                                   |
| <b>ÄGYPTEN</b>  |            |              |                    |                                   | EFG-HERMES HOLDING  | 12.082.851 | EGP          | 4.499.205          | 0,99                              |
| COMMERCIAL  |            |              |                    |                                   |   |            |              | <b>4.499.205</b>   | <b>0,99</b>                       |
| INTERNATIONAL BANK  | 3.750.563  | USD          | 6.008.402          | 1,33                              | <b>SUMME AKTIEN</b>   |            |              | <b>4.499.205</b>   | <b>0,99</b>                       |
|   |            |              | <b>6.008.402</b>   | <b>1,33</b>                       | <b>SUMME SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>  |            |              | <b>4.499.205</b>   | <b>0,99</b>                       |
| <b>KASACHSTAN</b>   |            |              |                    |                                   | <b>SUMME WERTPAPIERANLAGEN</b>  |            |              | <b>445.852.926</b> | <b>98,59</b>                      |
| AIR ASTANA JSC  | 600.000    | USD          | 5.286.000          | 1,17                              | <b>SONSTIGES NETTOVERMÖGEN</b>  |            |              | <b>6.382.416</b>   | <b>1,41</b>                       |
| HALYK SAVINGS BANK  |            |              |                    |                                   | <b>GESAMTNETTOVERMÖGEN</b>  |            |              | <b>452.235.342</b> | <b>100,00</b>                     |
| KASACHSTAN  | 976.829    | USD          | 17.582.922         | 3,89                              |   |            |              |                    |                                   |
| KASPI   | 65.000     | USD          | 8.346.000          | 1,85                              |   |            |              |                    |                                   |
| KASPI (US48581R2058)  | 145.606    | USD          | 17.560.084         | 3,88                              |   |            |              |                    |                                   |
| NAC KAZATOMPROM   | 301.093    | USD          | 11.908.228         | 2,63                              |   |            |              |                    |                                   |
|   |            |              | <b>60.683.234</b>  | <b>13,42</b>                      |   |            |              |                    |                                   |
| <b>SLOWENIEN</b>  |            |              |                    |                                   |   |            |              |                    |                                   |
| NOVA LJUBLJANSKA BANKA  | 348.261    | EUR          | 8.161.844          | 1,80                              |   |            |              |                    |                                   |
|   |            |              | <b>8.161.844</b>   | <b>1,80</b>                       |   |            |              |                    |                                   |
| <b>SUMME DEPOSITARY RECEIPTS</b>  |            |              | <b>74.853.480</b>  | <b>16,55</b>                      |   |            |              |                    |                                   |
| <b>VORZUGSAKTIEN</b>  |            |              |                    |                                   |   |            |              |                    |                                   |
| <b>KOLUMBIEN</b>  |            |              |                    |                                   |   |            |              |                    |                                   |
| BANCO DAVIVIENDA  | 277.646    | COP          | 1.458.176          | 0,32                              |   |            |              |                    |                                   |
|   |            |              | <b>1.458.176</b>   | <b>0,32</b>                       |   |            |              |                    |                                   |
| <b>SUMME VORZUGSAKTIEN</b>  |            |              | <b>1.458.176</b>   | <b>0,32</b>                       |   |            |              |                    |                                   |
| <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN<br/>BÖRSE NOTIERTEN WERTPAPIERE<br/>WERTPAPIERE</b> |            |              | <b>423.148.024</b> | <b>93,57</b>                      |   |            |              |                    |                                   |
| <b>AN EINEM ANDEREM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE, ÜBERTRAGBARE<br/>WERTPAPIERE</b>    |            |              |                    |                                   |   |            |              |                    |                                   |
| <b>AKTIEN</b>   |            |              |                    |                                   |   |            |              |                    |                                   |
| <b>KATAR</b>  |            |              |                    |                                   |   |            |              |                    |                                   |
| OOREDOO QSC   | 1.031.747  | QAR          | 3.003.713          | 0,66                              |   |            |              |                    |                                   |
|   |            |              | <b>3.003.713</b>   | <b>0,66</b>                       |   |            |              |                    |                                   |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Equity Volatility Focused  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl  | Wäh-<br>rung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens | Beschreibung                                   | Anzahl  | Wäh-<br>rung | Kurswert | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |
|---|---------|--------------|------------------|-----------------------------------|--|---------|--------------|----------|-----------------------------------|
| <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>  |         |              |                  |                                   | <b>CHINA</b>                                   |         |              |          |                                   |
| <b>AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |         |              |                  |                                   | AGRICULTURAL BANK OF CHINA                     |         |              |          |                                   |
| <b>AKTIEN</b>   |         |              |                  |                                   | 142.800 CNY 82.391 0,06                        |         |              |          |                                   |
| <b>AUSTRALIEN</b>   |         |              |                  |                                   | AIER EYE HOSPITAL GROUP 12.570 CNY 22.366 0,02 |         |              |          |                                   |
| BRAMBLES  | 46.272  | AUD          | 487.534          | 0,38                              | ANHUI CONCH CEMENT „H“                         | 1.979   | HKD          | 4.117    | 0,00                              |
| COCHLEAR  | 2.319   | AUD          | 510.639          | 0,40                              | BANK OF BEIJING                                | 18.400  | CNY          | 14.384   | 0,01                              |
| COLES GROUP   | 6.365   | AUD          | 70.344           | 0,05                              | BANK OF CHINA „A“                              | 55.400  | CNY          | 33.574   | 0,03                              |
| MEDIBANK  | 97.493  | AUD          | 239.153          | 0,19                              | BANK OF NINGBO                                 | 2.065   | CNY          | 5.949    | 0,00                              |
| SONIC HEALTHCARE  | 12.855  | AUD          | 246.650          | 0,19                              | BAOSHAN IRON AND STEEL                         | 28.400  | CNY          | 25.424   | 0,02                              |
| WOOLWORTHS  | 3.257   | AUD          | 70.482           | 0,05                              | CHINA CITIC BANK „H“                           | 228.000 | HKD          | 121.480  | 0,09                              |
|   |         |              | <b>1.624.802</b> | <b>1,26</b>                       | CHINA CONSTRUCTIONS BANK                       | 13.600  | CNY          | 12.852   | 0,01                              |
|   |         |              |                  |                                   | CHINA COSCO HOLDINGS „H“                       | 43.900  | HKD          | 46.164   | 0,04                              |
|   |         |              |                  |                                   | CHINA EVERBRIGHT BANK                          | 23.700  | CNY          | 10.231   | 0,01                              |
|   |         |              |                  |                                   | CHINA INTERNATIONAL TRAVEL SERVICE „A“         | 2.700   | CNY          | 32.195   | 0,02                              |
| <b>ÖSTERREICH</b>   |         |              |                  |                                   | CHINA LIFE INSURANCE „H“                       | 142.038 | HKD          | 170.414  | 0,13                              |
| VERBUND   | 2.341   | EUR          | 171.417          | 0,13                              | CHINA MERCHANTS BANK „A“                       | 2.731   | CNY          | 12.160   | 0,01                              |
|   |         |              | <b>171.417</b>   | <b>0,13</b>                       | CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP „H“              | 72.027  | HKD          | 126.081  | 0,10                              |
| <b>BRASILIEN</b>  |         |              |                  |                                   | CHINA RAILWAY SIGNAL & COMMUNICATION           | 6.502   | CNY          | 4.939    | 0,00                              |
| ATACADAO DISTRIBUICAO COMERCIO                                    |         |              |                  |                                   | CHINA SHENHUA ENERGY „H“                       | 104.853 | HKD          | 411.967  | 0,33                              |
| E INDUSTRIA LTDA  | 14.100  | BRL          | 38.648           | 0,03                              | CHINA SHENHUA ENERGY COMPANY                   | 4.100   | CNY          | 21.920   | 0,02                              |
| BB SEGURIDADE   |         |              |                  |                                   | CHINA SOUTH LOCOMOTIVE „H“                     | 68.390  | HKD          | 36.876   | 0,03                              |
| PARTICIPACOES   | 20.219  | BRL          | 132.246          | 0,11                              | CHINA TOWER CORP                               | 946.195 | HKD          | 108.807  | 0,08                              |
| CAIXA SEGURIDADE  |         |              |                  |                                   | CHINA UNITED NETWORK COMMUNICATIONS            | 24.100  | CNY          | 15.372   | 0,01                              |
| PARTICIPACOES   | 21.240  | BRL          | 67.299           | 0,05                              | CITIC SECURITIES „A“                           | 11.162  | CNY          | 29.822   | 0,02                              |
| CPFL ENERGIA  | 737     | BRL          | 5.105            | 0,00                              | HENGAN INTERNATIONAL GROUP                     | 5.637   | HKD          | 17.754   | 0,01                              |
| ENGIE BRASIL ENERGIA  | 1.387   | BRL          | 11.120           | 0,01                              | HKT TRUST                                      | 133.000 | HKD          | 155.152  | 0,12                              |
| TIM SA/BRASIL   | 29.994  | BRL          | 106.121          | 0,08                              | ICBC „H“                                       | 250.496 | HKD          | 126.105  | 0,10                              |
|   |         |              | <b>360.539</b>   | <b>0,28</b>                       | INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA          | 45.532  | CNY          | 33.074   | 0,03                              |
| <b>KANADA</b>   |         |              |                  |                                   | JIANGSU YANGHE BREWERY                         |         |              |          |                                   |
| ALIMENTATION COUCH  | 12.349  | CAD          | 709.412          | 0,55                              | JOINT-STOCK                                    | 2.700   | CNY          | 36.835   | 0,03                              |
| CANADIAN UTILITIES „A“  | 2.183   | CAD          | 49.395           | 0,04                              | KUNLUN ENERGY                                  | 75.552  | HKD          | 63.037   | 0,05                              |
| CGI   | 6.982   | CAD          | 771.335          | 0,60                              | LUZHOU LAOJIAO                                 | 1.674   | CNY          | 42.863   | 0,03                              |
| EMPIRE A SHARES   | 4.288   | CAD          | 104.693          | 0,08                              | NEW CHINA LIFE INSURANCE „H“                   | 15.400  | HKD          | 27.272   | 0,02                              |
| GREAT WEST LIFECO   | 8.528   | CAD          | 272.430          | 0,21                              | ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL                  | 4.767   | HKD          | 56.950   | 0,04                              |
| HYDRO ONE   | 9.417   | CAD          | 274.734          | 0,21                              | PEOPLE'S INSURANCE GROUP OF CHINA „H“          | 153.950 | HKD          | 49.176   | 0,04                              |
| IA FINANCIAL  | 2.869   | CAD          | 179.995          | 0,14                              | PETROCHINA „H“                                 | 40.000  | HKD          | 34.192   | 0,03                              |
| LOBLAW  | 5.033   | CAD          | 557.507          | 0,43                              | PICC PROPERTY & CASUALTY „H“                   | 199.320 | HKD          | 262.824  | 0,20                              |
| MANULIFE FINANCIAL CORP   | 49.270  | CAD          | 1.230.248        | 0,94                              | PING AN BANK                                   | 20.270  | CNY          | 29.420   | 0,02                              |
| METRO, INC.   | 7.136   | CAD          | 383.733          | 0,30                              | PING AN INSURANCE                              | 2.474   | CNY          | 13.928   | 0,01                              |
| NORTHLAND POWER   | 1.976   | CAD          | 32.241           | 0,02                              | SHAANXI COAL INDUSTRY                          | 1.249   | CNY          | 4.320    | 0,00                              |
| POWER CORP OF CANADA  | 5.902   | CAD          | 165.731          | 0,13                              |  |         |              |          |                                   |
| RIOCAN REIT   | 902     | CAD          | 12.321           | 0,01                              |  |         |              |          |                                   |
| SUN LIFE FINANCIAL SERVICES                                       | 5.788   | CAD          | 316.763          | 0,25                              |  |         |              |          |                                   |
| TOROMONT INDUSTRIES   | 2.915   | CAD          | 279.943          | 0,22                              |  |         |              |          |                                   |
| WESTON GEORGE   | 1.773   | CAD          | 239.894          | 0,19                              |  |         |              |          |                                   |
|   |         |              | <b>5.580.375</b> | <b>4,32</b>                       |  |         |              |          |                                   |
| <b>CHILE</b>  |         |              |                  |                                   |  |         |              |          |                                   |
| CENCOSUD  | 36.995  | CLP          | 64.119           | 0,05                              |  |         |              |          |                                   |
| ENERSIS   | 132.204 | CLP          | 7.939            | 0,01                              |  |         |              |          |                                   |
|   |         |              | <b>72.058</b>    | <b>0,06</b>                       |  |         |              |          |                                   |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Equity Volatility Focused (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung                                | Anzahl | Wäh-<br>rung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens | Beschreibung                                  | Anzahl  | Wäh-<br>rung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |
|---|--------|--------------|------------------|-----------------------------------|---|---------|--------------|------------------|-----------------------------------|
| SHANDONG WEIGAO GP<br>MEDICAL „H“           | 60.657 | HKD          | 37.821           | 0,03                              | NEXT  | 2.752   | GBP          | 321.781          | 0,25                              |
| SHANGHAI PUDONG<br>DEVELOPMENT BANK         | 50.200 | CNY          | 49.801           | 0,04                              | ROLLS ROYCE                                   | 163.280 | GBP          | 882.292          | 0,68                              |
| SHENZHEN MINDRAY BIO<br>MEDICAL ELECTRONICS | 111    | CNY          | 4.299            | 0,00                              | ROYALTY PHARMA                                | 13.262  | USD          | 406.215          | 0,31                              |
| TONGWEI                                     | 2.312  | CNY          | 7.901            | 0,01                              | SAINSBURY (J)                                 | 47.288  | GBP          | 161.886          | 0,13                              |
| TOPSPORTS INTERNATIONAL<br>HOLDINGS         | 16.000 | HKD          | 10.712           | 0,01                              | SMITHS GROUP                                  | 9.404   | GBP          | 194.944          | 0,15                              |
| WUXI APPTEC                                 | 1.986  | CNY          | 12.923           | 0,01                              | TAYLOR WIMPEY                                 | 100.735 | GBP          | 174.528          | 0,14                              |
| ZIGIN MINING GROUP „A“                      | 5.752  | CNY          | 12.813           | 0,01                              | TESCO   | 233.742 | GBP          | 878.442          | 0,68                              |
| ZTE „H“                                     | 4.369  | HKD          | 8.708            | 0,01                              | VODAFONE GROUP                                | 604.941 | GBP          | 538.755          | 0,42                              |
|   |        |              | <b>2.447.365</b> | <b>1,89</b>                       |   |         |              | <b>6.602.066</b> | <b>5,11</b>                       |
| <b>KOLUMBIEN</b>                            |        |              |                  |                                   | <b>GRIECHENLAND</b>                           |         |              |                  |                                   |
| BANCOLOMBIA                                 | 2.150  | COP          | 19.068           | 0,01                              | GREEK ORGANISATION OF<br>FOOTBALL PROGNOSTICS | 3.124   | EUR          | 56.277           | 0,04                              |
|   |        |              | <b>19.068</b>    | <b>0,01</b>                       | JUMBO   | 2.402   | EUR          | 69.264           | 0,06                              |
| <b>TSCHECHISCHE REPUBLIK</b>                |        |              |                  |                                   |   |         |              | <b>125.541</b>   | <b>0,10</b>                       |
| CEZ   | 4.275  | CZK          | 152.828          | 0,12                              | <b>HONGKONG</b>                               |         |              |                  |                                   |
| KOMERCNI BANKA                              | 811    | CZK          | 29.097           | 0,02                              | BEIJING ENTERPRISE                            | 1.930   | HKD          | 5.598            | 0,00                              |
|   |        |              | <b>181.925</b>   | <b>0,14</b>                       | BOC HONG KONG HOLDINGS                        | 109.850 | HKD          | 294.049          | 0,23                              |
| <b>DÄNEMARK</b>                             |        |              |                  |                                   | CHINA MERCHANTS<br>HOLDINGS                   | 9.543   | HKD          | 11.449           | 0,01                              |
| A P MOLLER – MAERSK                         | 80     | DKK          | 102.338          | 0,08                              | CK INFRASTRUCTURE<br>HOLDINGS                 | 12.326  | HKD          | 72.131           | 0,06                              |
| ROCKWOOL INTERNATIONAL<br>„B“               | 198    | DKK          | 65.049           | 0,05                              | CLP HOLDINGS                                  | 50.274  | HKD          | 400.511          | 0,30                              |
| WILLIAM DEMANT HOLDING                      | 3.567  | DKK          | 177.150          | 0,14                              | HANG SENG BANK                                | 7.676   | HKD          | 84.004           | 0,07                              |
|   |        |              | <b>344.537</b>   | <b>0,27</b>                       | KINGBOARD CHEMICALS                           | 500     | HKD          | 1.020            | 0,00                              |
| <b>FINNLAND</b>                             |        |              |                  |                                   | LENOVO GROUP                                  | 259.475 | HKD          | 300.703          | 0,23                              |
| KESKO UYJ „B“                               | 7.853  | EUR          | 146.810          | 0,11                              | POWER ASSETS HOLDINGS                         | 38.713  | HKD          | 226.547          | 0,18                              |
| NOKIA                                       | 17.444 | EUR          | 61.926           | 0,05                              |   |         |              | <b>1.396.012</b> | <b>1,08</b>                       |
| WARTSILA CORP                               | 14.308 | EUR          | 218.268          | 0,17                              | <b>INDIEN</b>                                 |         |              |                  |                                   |
|   |        |              | <b>427.004</b>   | <b>0,33</b>                       | ADANI POWER                                   | 27.308  | INR          | 174.779          | 0,14                              |
| <b>FRANKREICH</b>                           |        |              |                  |                                   | AUROBINDO PHARMA                              | 5.489   | INR          | 71.654           | 0,06                              |
| CARREFOUR                                   | 16.802 | EUR          | 287.344          | 0,22                              | BHARAT ELECTRONICS                            | 129.385 | INR          | 312.593          | 0,24                              |
| DASSAULT AVIATION                           | 641    | EUR          | 141.225          | 0,11                              | CIPLA   | 5.905   | INR          | 105.986          | 0,08                              |
| IPSEN PROMESSES                             | 1.331  | EUR          | 159.417          | 0,12                              | COAL INDIA                                    | 35.985  | INR          | 187.298          | 0,15                              |
| KLEPIERRE                                   | 5.533  | EUR          | 143.535          | 0,11                              | COLGATE-PALMOLIVE (INDIA)                     | 2.375   | INR          | 77.181           | 0,06                              |
| ORANGE                                      | 35.782 | EUR          | 420.066          | 0,33                              | DR REDDYS LABORATORIES                        | 3.881   | INR          | 286.548          | 0,22                              |
| THALES                                      | 1.647  | EUR          | 281.667          | 0,22                              | HCL TECHNOLOGIES                              | 30.118  | INR          | 557.401          | 0,43                              |
|   |        |              | <b>1.433.254</b> | <b>1,11</b>                       | HINDUSTAN AERONAUTICS                         | 7.103   | INR          | 283.345          | 0,22                              |
| <b>DEUTSCHLAND</b>                          |        |              |                  |                                   | INDRAPRASTHA GAS                              | 351     | INR          | 1.813            | 0,00                              |
| DEUTSCHE TELEKOM                            | 30.933 | EUR          | 752.841          | 0,58                              | ITC   | 1.087   | INR          | 5.583            | 0,00                              |
| FRESENIUS                                   | 1.325  | EUR          | 35.775           | 0,03                              | LUPIN   | 4.162   | INR          | 80.682           | 0,06                              |
| HENKEL                                      | 2.884  | EUR          | 208.312          | 0,16                              | NTPC  | 27.803  | INR          | 111.942          | 0,09                              |
| KNORR BREMSE                                | 1.863  | EUR          | 141.004          | 0,11                              | POWER GRID CORPORATION                        |         |              |                  |                                   |
| RATIONAL                                    | 181    | EUR          | 156.091          | 0,12                              | OF INDIA                                      | 146.572 | INR          | 486.626          | 0,38                              |
| TALANX                                      | 1.487  | EUR          | 117.556          | 0,09                              | SBI LIFE INSURANCE                            | 4.484   | INR          | 80.659           | 0,06                              |
|   |        |              | <b>1.411.579</b> | <b>1,09</b>                       | SUN PHARMACEUTICALS                           | 26.795  | INR          | 520.640          | 0,40                              |
| <b>GROSSBRITANNIEN</b>                      |        |              |                  |                                   |   |         |              | <b>3.344.730</b> | <b>2,59</b>                       |
| 3I GROUP                                    | 32.402 | GBP          | 1.153.459        | 0,88                              | <b>INDONESIEN</b>                             |         |              |                  |                                   |
| GSK PLC                                     | 36.370 | GBP          | 786.155          | 0,61                              | ADARO ENERGY                                  | 353.724 | IDR          | 60.237           | 0,05                              |
| HIKMA PHARMACEUTICALS                       | 5.776  | GBP          | 140.823          | 0,11                              | AMMAN MINERAL                                 |         |              |                  |                                   |
| NATIONAL GRID                               | 71.597 | GBP          | 962.786          | 0,75                              | INTERNASIONAL                                 | 162.070 | IDR          | 89.443           | 0,07                              |
|   |        |              |                  |                                   | ASTRA INTERNATIONAL                           | 134.100 | IDR          | 43.558           | 0,03                              |
|   |        |              |                  |                                   | INDOFOOD SUKSES MAKMUR                        | 29.900  | IDR          | 12.022           | 0,01                              |
|   |        |              |                  |                                   | SUMBER ALFARIA TRIJAYA                        | 197.234 | IDR          | 36.200           | 0,03                              |
|   |        |              |                  |                                   |   |         |              | <b>241.460</b>   | <b>0,19</b>                       |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Equity Volatility Focused (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung          | Anzahl  | Wäh-<br>rung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens | Beschreibung                   | Anzahl | Wäh-<br>rung | Kurswert       | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |
|-----------------------|---------|--------------|------------------|-----------------------------------|--------------------------------|--------|--------------|----------------|-----------------------------------|
| <b>IRLAND</b>         |         |              |                  |                                   | <b>MALAYAN BANKING</b>         |        |              |                |                                   |
| ACCENTURE CORP        | 1.198   | USD          | 410.973          | 0,31                              | MAXIS                          | 20.928 | MYR          | 14.901         | 0,01                              |
| AIB GROUP             | 41.955  | EUR          | 214.323          | 0,17                              | MISC BERHAD                    | 39.100 | MYR          | 63.198         | 0,05                              |
| STERIS                | 288     | USD          | 64.786           | 0,05                              | NESTLE BERHAD                  | 200    | MYR          | 4.986          | 0,00                              |
|                       |         |              | <b>690.082</b>   | <b>0,53</b>                       | PETRONAS GAS                   | 26.400 | MYR          | 97.836         | 0,08                              |
| <b>ITALIEN</b>        |         |              |                  |                                   | <b>RHB CAPITAL</b>             |        |              |                |                                   |
| GENERALI              | 29.194  | EUR          | 740.628          | 0,57                              | SIME DARBY                     | 61.600 | MYR          | 33.839         | 0,03                              |
| SNAM                  | 65.689  | EUR          | 309.600          | 0,24                              | TELEKOM MALAYSIA               | 32.634 | MYR          | 41.439         | 0,03                              |
|                       |         |              | <b>1.050.228</b> | <b>0,81</b>                       | TENAGA NASIONAL                | 82.300 | MYR          | 195.448        | 0,15                              |
| <b>JAPAN</b>          |         |              |                  |                                   | <b>YTL POWER INTERNATIONAL</b> |        |              |                |                                   |
| ASAHI INTECC          | 7.604   | JPY          | 132.742          | 0,10                              |                                | 77.772 | MYR          | 62.112         | 0,05                              |
| BROTHER INDUSTRIES    | 5.432   | JPY          | 100.460          | 0,08                              |                                |        |              | <b>637.080</b> | <b>0,49</b>                       |
| CHUBU ELECTRIC POWER  | 19.227  | JPY          | 250.842          | 0,19                              | <b>MEXIKO</b>                  |        |              |                |                                   |
| CHUGAI PHARMACEUTICAL | 2.502   | JPY          | 95.322           | 0,07                              | FIBRA UNO ADMINISTRATION       | 22.991 | MXN          | 38.190         | 0,03                              |
| DAI NIPPON PRINTING   | 6.390   | JPY          | 195.147          | 0,15                              |                                |        |              | <b>38.190</b>  | <b>0,03</b>                       |
| FUJI PHOTO FILM       | 1.035   | JPY          | 23.169           | 0,02                              | <b>NIEDERLANDE</b>             |        |              |                |                                   |
| ITOCHU                | 17.407  | JPY          | 743.459          | 0,58                              | AHOLD DELHAIZE                 | 3.087  | EUR          | 92.301         | 0,07                              |
| JAPAN TOBACCO         | 41.700  | JPY          | 1.109.834        | 0,85                              | BE SEMICONDUCTOR               |        |              |                |                                   |
| KDDI                  | 30.620  | JPY          | 903.962          | 0,70                              | INDUSTRIES                     | 596    | EUR          | 91.209         | 0,07                              |
| KYOWA HAKKO KOGYO     | 7.898   | JPY          | 141.683          | 0,11                              | KONINKLIJKE PHILIPS            | 636    | EUR          | 12.762         | 0,01                              |
| NKSJ HOLDINGS         | 29.934  | JPY          | 625.005          | 0,48                              |                                |        |              | <b>196.272</b> | <b>0,15</b>                       |
| NOMURA REAL ESTATE    |         |              |                  |                                   | <b>NORWEGEN</b>                |        |              |                |                                   |
| MASTER FUND           | 90      | JPY          | 88.962           | 0,07                              | TELENOR                        | 20.627 | NOK          | 229.588        | 0,18                              |
| NTT                   | 800.460 | JPY          | 952.017          | 0,74                              |                                |        |              | <b>229.588</b> | <b>0,18</b>                       |
| ONO PHARMACEUTICALS   | 10.893  | JPY          | 178.281          | 0,14                              | <b>PHILIPPINEN</b>             |        |              |                |                                   |
| ORIX                  | 6.198   | JPY          | 135.062          | 0,10                              | BDO UNIBANK                    | 65.321 | PHP          | 179.527        | 0,14                              |
| OSAKA GAS             | 2.200   | JPY          | 49.394           | 0,04                              | INTERNATIONAL CONTAINER        |        |              |                |                                   |
| RENASAS ELECTRONICS   | 3.569   | JPY          | 63.294           | 0,05                              | TERMINAL                       | 24.821 | PHP          | 140.409        | 0,11                              |
| RICOH                 | 18.901  | JPY          | 167.536          | 0,13                              | MANILA ELECTRIC                | 8.472  | PHP          | 53.802         | 0,04                              |
| SECOM                 | 6.348   | JPY          | 459.705          | 0,36                              | METROPOLITAN BANK &            |        |              |                |                                   |
| SEIKO EPSON           | 6.637   | JPY          | 115.554          | 0,09                              | TRUST                          | 37.190 | PHP          | 43.101         | 0,03                              |
| SEVEN AND I HOLDINGS  | 1.400   | JPY          | 20.351           | 0,02                              | PHILIPPINE LONG                |        |              |                |                                   |
| SHIMIZU               | 400     | JPY          | 2.576            | 0,00                              | DISTANCE TELEPHONE             | 425    | PHP          | 10.358         | 0,01                              |
| SHIONOGI              | 8.292   | JPY          | 423.681          | 0,33                              | UNIVERSAL ROBINA               | 21.300 | PHP          | 39.898         | 0,03                              |
| SOFTBANK CORP         | 19.833  | JPY          | 254.358          | 0,20                              |                                |        |              | <b>467.095</b> | <b>0,36</b>                       |
| SUMITOMO CORP         | 35.301  | JPY          | 846.692          | 0,66                              | <b>POLEN</b>                   |        |              |                |                                   |
| T&D HOLDINGS          | 2.200   | JPY          | 38.180           | 0,03                              | BANK ZACHODNI WBK              | 1.266  | PLN          | 180.801        | 0,14                              |
| TOKYO GAS             | 12.064  | JPY          | 273.890          | 0,21                              | BUDIMEX                        | 100    | PLN          | 17.554         | 0,01                              |
| TOPPAN PRINTING       | 6.804   | JPY          | 169.757          | 0,13                              | POLSKA GRUPA                   |        |              |                |                                   |
| TOYOTA TSUSHO         | 6.616   | JPY          | 451.573          | 0,35                              | ENERGETYCZNA                   | 32.395 | PLN          | 58.506         | 0,05                              |
| USS                   | 8.834   | JPY          | 72.933           | 0,06                              |                                |        |              | <b>256.861</b> | <b>0,20</b>                       |
|                       |         |              | <b>9.085.421</b> | <b>7,04</b>                       | <b>KATAR</b>                   |        |              |                |                                   |
| <b>JERSEY</b>         |         |              |                  |                                   | QATAR ELECTRICITY &            |        |              |                |                                   |
| FERGUSON NEWCO        | 5.390   | USD          | 1.183.132        | 0,92                              | WATER                          | 15.156 | QAR          | 67.559         | 0,05                              |
|                       |         |              | <b>1.183.132</b> | <b>0,92</b>                       | QATAR INTERNATIONAL            |        |              |                |                                   |
| <b>KUWAIT</b>         |         |              |                  |                                   | ISLAMIC BANK                   |        |              |                |                                   |
| GULF BANK OF KUWAIT   | 6.834   | KWD          | 6.532            | 0,01                              |                                | 27.734 | QAR          | 83.255         | 0,07                              |
|                       |         |              | <b>6.532</b>     | <b>0,01</b>                       |                                |        |              | <b>150.814</b> | <b>0,12</b>                       |
| <b>MALAYSIA</b>       |         |              |                  |                                   | <b>SAUDI-ARABIEN</b>           |        |              |                |                                   |
| DIGI COM              | 37.600  | MYR          | 33.445           | 0,03                              | ELM                            | 619    | SAR          | 158.278        | 0,12                              |
| GENTING               | 27.914  | MYR          | 27.837           | 0,02                              | ETIHAD ETISALAT                | 9.074  | SAR          | 127.261        | 0,10                              |
| GENTING MALAYSIA      | 26.821  | MYR          | 15.470           | 0,01                              | JARIR MARKETING                | 5.016  | SAR          | 19.660         | 0,02                              |
|                       |         |              |                  |                                   | SAUDI ELECTRICITY              | 19.123 | SAR          | 100.854        | 0,08                              |
|                       |         |              |                  |                                   | THE COMPANY FOR                |        |              |                |                                   |
|                       |         |              |                  |                                   | COOPERATIVE INSURANCE          | 1.848  | SAR          | 79.823         | 0,06                              |
|                       |         |              |                  |                                   |                                |        |              | <b>485.876</b> | <b>0,38</b>                       |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Equity Volatility Focused (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung              | Anzahl  | Währung | Kurswert         | % des Nettovermögens | Beschreibung                        | Anzahl | Währung | Kurswert         | % des Nettovermögens |
|---------------------------|---------|---------|------------------|----------------------|-------------------------------------|--------|---------|------------------|----------------------|
| <b>SINGAPUR</b>           |         |         |                  |                      | <b>COMPAL ELECTRONICS</b>           |        |         |                  |                      |
| GENTING                   | 121.638 | SGD     | 79.764           | 0,06                 | EVA AIRWAYS                         | 34.420 | TWD     | 33.986           | 0,03                 |
| JARDINE CYCLE & CARRIAGE  | 1.164   | SGD     | 20.846           | 0,02                 | FAR EASTERN NEW CENTURY             | 55.000 | TWD     | 56.798           | 0,04                 |
| SEMBCORP INDUSTRIES       | 29.715  | SGD     | 118.895          | 0,09                 | FAR EASTONE TELEKOMMUNIKATION       | 53.000 | TWD     | 133.976          | 0,10                 |
| SINGAPORE AIRLINES        | 46.845  | SGD     | 222.146          | 0,17                 | INVENTEC                            | 90.000 | TWD     | 164.513          | 0,13                 |
|                           |         |         | <b>441.651</b>   | <b>0,34</b>          | LITE-ON TECHNOLOGY                  | 58.994 | TWD     | 195.397          | 0,15                 |
| <b>SÜDAFRIKA</b>          |         |         |                  |                      | MICRO-STAR INTERNATIONAL            | 14.943 | TWD     | 77.975           | 0,06                 |
| ASPEN PHARMACARE HOLDINGS | 96      | ZAR     | 1.112            | 0,00                 | PEGATRON CORP                       | 60.000 | TWD     | 186.917          | 0,14                 |
| KUMBA IRON ORE            | 161     | ZAR     | 3.930            | 0,00                 | POU CHEN                            | 22.436 | TWD     | 25.413           | 0,02                 |
| OUTSURANCE GROUP          | 2.468   | ZAR     | 5.474            | 0,01                 | PRESIDENT CHAIN STORE               | 14.847 | TWD     | 123.170          | 0,10                 |
|                           |         |         | <b>10.516</b>    | <b>0,01</b>          | TAIWAN SEMICONDUCTOR                |        |         |                  |                      |
| <b>SÜDKOREA</b>           |         |         |                  |                      | VERARBEITENDES GEWERBE              | 2.597  | TWD     | 62.402           | 0,05                 |
| DONGBU INSURANCE          | 1.007   | KRW     | 72.033           | 0,06                 |                                     |        |         | <b>1.842.058</b> | <b>1,43</b>          |
| DOOSAN BOBCAT             | 1.485   | KRW     | 59.565           | 0,05                 | <b>THAILAND</b>                     |        |         |                  |                      |
| GS HOLDINGS               | 273     | KRW     | 9.835            | 0,01                 | ADVANCED INFO SERVICES              | 11.450 | THB     | 64.016           | 0,04                 |
| HANA FINANCIAL HOLDINGS   | 8.989   | KRW     | 393.279          | 0,29                 | BUMRUNGRAD HOSPITAL                 | 10.431 | THB     | 63.751           | 0,05                 |
| HANKOOK TIRE              | 503     | KRW     | 20.213           | 0,02                 | BUMRUNGRAD HOSPITAL FOREIGN         | 10.465 | THB     | 63.959           | 0,05                 |
| KANGWON LAND              | 262     | KRW     | 3.196            | 0,00                 | INTOUCH HOLDINGS PUBLIC COMPANY     | 10.294 | THB     | 19.396           | 0,02                 |
| KIA MOTORS                | 9.241   | KRW     | 768.796          | 0,59                 |                                     |        |         | <b>211.122</b>   | <b>0,16</b>          |
| KOREAN AIRLINES           | 3.668   | KRW     | 59.124           | 0,05                 | <b>VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE</b> |        |         |                  |                      |
| KT & G                    | 3.339   | KRW     | 232.397          | 0,18                 | ABU DHABI ISLAMIC BANK              | 35.145 | AED     | 104.510          | 0,08                 |
| LG UPLUS CORP             | 6.092   | KRW     | 45.478           | 0,04                 | EMAAR PROPERTIES                    | 6.586  | AED     | 14.617           | 0,01                 |
| N C SOFT                  | 250     | KRW     | 38.254           | 0,03                 | EMIRATES NBD                        | 57.149 | AED     | 269.233          | 0,21                 |
| ORION CORP                | 23      | KRW     | 1.568            | 0,00                 |                                     |        |         | <b>388.360</b>   | <b>0,30</b>          |
| SAMSUNG ELECTRONICS       | 4.195   | KRW     | 251.778          | 0,19                 | <b>USA</b>                          |        |         |                  |                      |
| SK BIOSCIENCE             | 499     | KRW     | 22.870           | 0,02                 | ABBVIE                              | 4.460  | USD     | 809.089          | 0,63                 |
| SK TELECOM                | 231     | KRW     | 9.146            | 0,01                 | ALPHABET „A“                        | 10.646 | USD     | 1.601.797        | 1,24                 |
|                           |         |         | <b>1.987.532</b> | <b>1,54</b>          | ALTRIA GROUP                        | 28.174 | USD     | 1.232.331        | 0,95                 |
| <b>SPANIEN</b>            |         |         |                  |                      | AMAZON.COM                          | 13.316 | USD     | 2.405.136        | 1,86                 |
| BANCO BILBAO VIZCAYA      | 1.443   | EUR     | 17.221           | 0,01                 | AMERICAN EXPRESS                    | 277    | USD     | 62.907           | 0,05                 |
| BANCO SANTANDER           | 265.181 | EUR     | 1.294.937        | 1,00                 | AMERICAN FINANCIAL GROUP            | 671    | USD     | 91.967           | 0,07                 |
| ENAGAS                    | 5.811   | EUR     | 86.356           | 0,07                 | AMERICAN INTERNATIONAL GROUP        | 7.791  | USD     | 610.814          | 0,47                 |
| ENDESA                    | 10.227  | EUR     | 189.314          | 0,15                 | AMGEN                               | 1.835  | USD     | 525.397          | 0,41                 |
| RED ELECTRICA CORPORACION | 12.077  | EUR     | 206.017          | 0,16                 | APPLE                               | 30.889 | USD     | 5.285.416        | 4,10                 |
| REPSOL                    | 34.910  | EUR     | 581.189          | 0,45                 | ARCH CAPITAL GROUP                  | 12.606 | USD     | 1.157.357        | 0,90                 |
|                           |         |         | <b>2.375.034</b> | <b>1,84</b>          | AT&T                                | 9.104  | USD     | 159.957          | 0,12                 |
| <b>SCHWEIZ</b>            |         |         |                  |                      | ATMOS ENERGY                        | 4.830  | USD     | 574.190          | 0,44                 |
| ACE                       | 1.043   | USD     | 269.386          | 0,21                 | BECTON DICKINSON                    | 1.332  | USD     | 328.964          | 0,25                 |
| BALOISE HOLDING           | 1.572   | CHF     | 246.612          | 0,19                 | BROADCOM CORP                       | 43     | USD     | 56.932           | 0,04                 |
| BKW                       | 423     | CHF     | 64.904           | 0,05                 | BUILDERS FIRSTSOURCE                | 1.588  | USD     | 333.734          | 0,26                 |
| GARMIN                    | 4.966   | USD     | 738.146          | 0,57                 | CENTERPOINT ENERGY                  | 7.700  | USD     | 218.950          | 0,17                 |
| NOVARTIS                  | 13.028  | CHF     | 1.262.445        | 0,97                 | CHURCH & DWIGHT                     | 2.088  | USD     | 217.173          | 0,17                 |
| ROCHE HOLDING             | 2.577   | CHF     | 655.909          | 0,51                 | CINTAS                              | 1.906  | USD     | 1.309.632        | 1,01                 |
| SANDOZ GROUP              | 2.430   | CHF     | 73.032           | 0,06                 | CISCO SYSTEMS                       | 27.503 | USD     | 1.380.101        | 1,07                 |
| STRAUMANN HOLDING         | 3.951   | CHF     | 629.475          | 0,49                 | COGNIZANT TECHNOLOGY                |        |         |                  |                      |
| THE SWATCH GROUP „R“      | 816     | CHF     | 36.963           | 0,03                 | SOLUTIONS                           | 14.232 | USD     | 1.048.329        | 0,81                 |
|                           |         |         | <b>3.976.872</b> | <b>3,08</b>          | COLGATE-PALMOLIVE                   | 9.112  | USD     | 819.442          | 0,63                 |
| <b>TAIWAN</b>             |         |         |                  |                      | CONOCOPHILLIPS                      | 40     | USD     | 5.095            | 0,00                 |
| CATCHER TECHNOLOGY        | 14.507  | TWD     | 98.591           | 0,08                 |                                     |        |         |                  |                      |
| CATHAY FINANCIAL HOLDING  | 18.932  | TWD     | 28.543           | 0,02                 |                                     |        |         |                  |                      |
| CHINA AIR LINES           | 9.904   | TWD     | 6.035            | 0,00                 |                                     |        |         |                  |                      |
| CHUNGHWA TELECOM          | 132.668 | TWD     | 520.251          | 0,41                 |                                     |        |         |                  |                      |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Equity Volatility Focused (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung              | Anzahl | Wäh-<br>rung | Kurswert  | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens | Beschreibung                     | Anzahl | Wäh-<br>rung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |
|---------------------------|--------|--------------|-----------|-----------------------------------|----------------------------------|--------|--------------|--------------------|-----------------------------------|
| CONS EDISON               | 11.629 | USD          | 1.050.099 | 0,81                              | SEI INVESTMENTS                  | 1.043  | USD          | 75.482             | 0,06                              |
| COPART                    | 21.344 | USD          | 1.238.592 | 0,96                              | SIMON PROPERTY GROUP             | 4.236  | USD          | 658.020            | 0,51                              |
| COSTCO WHOLESALE          | 2.050  | USD          | 1.496.459 | 1,16                              | SKYWORKS SOLUTIONS               | 5.269  | USD          | 572.793            | 0,44                              |
| CSX                       | 31.847 | USD          | 1.178.817 | 0,91                              | SNAP-ON                          | 1.742  | USD          | 517.949            | 0,40                              |
| DAVITA HEALTHCARE         |        |              |           |                                   | STATE STREET                     | 804    | USD          | 62.101             | 0,05                              |
| PARTNERS                  | 1.485  | USD          | 204.618   | 0,16                              | TESLA MOTORS                     | 316    | USD          | 55.888             | 0,04                              |
| DELL TECHNOLOGIES         | 8.227  | USD          | 940.593   | 0,73                              | TEXAS INSTRUMENTS                | 5.889  | USD          | 1.028.043          | 0,80                              |
| DR HORTON                 | 2.448  | USD          | 404.165   | 0,31                              | T-MOBILE US                      | 7.197  | USD          | 1.178.005          | 0,91                              |
| DTE ENERGY                | 6.822  | USD          | 762.904   | 0,59                              | TRAVELERS COMPANIES              | 377    | USD          | 86.669             | 0,07                              |
| DUKE ENERGY               | 3.372  | USD          | 324.858   | 0,25                              | TYSON FOODS „A“                  | 752    | USD          | 44.300             | 0,03                              |
| EDISON INTERNATIONAL      | 2.970  | USD          | 209.147   | 0,16                              | UNION PACIFIC                    | 5.194  | USD          | 1.276.581          | 0,99                              |
| ELI LILLY                 | 138    | USD          | 108.683   | 0,08                              | UNITED THERAPEUTICS              | 1.659  | USD          | 399.272            | 0,31                              |
| EVEREST RE GROUP          | 1.385  | USD          | 551.576   | 0,43                              | UNITEDHEALTH GP                  | 1.088  | USD          | 536.112            | 0,42                              |
| EXELON                    | 12.584 | USD          | 470.642   | 0,36                              | UNIVERSAL HEALTH                 |        |              |                    |                                   |
| EXXON MOBIL               | 113    | USD          | 13.070    | 0,01                              | SERVICES „B“                     | 1.843  | USD          | 336.845            | 0,26                              |
| F5 NETWORKS               | 1.807  | USD          | 344.053   | 0,27                              | VEEVA SYSTEMS „A“                | 4.701  | USD          | 1.098.577          | 0,85                              |
| FACEBOOK                  | 1.661  | USD          | 809.904   | 0,63                              | VERISIGN                         | 482    | USD          | 91.402             | 0,07                              |
| FAIR ISSAC                | 47     | USD          | 59.034    | 0,05                              | VERIZON COMMUNICATIONS           | 33.520 | USD          | 1.402.812          | 1,09                              |
| FASTENAL                  | 15.860 | USD          | 1.229.150 | 0,95                              | VERTEX PHARMACEUTICALS           | 352    | USD          | 147.766            | 0,11                              |
| FNFV GROUP                | 9.153  | USD          | 481.997   | 0,37                              | VIATRIS                          | 6.462  | USD          | 76.542             | 0,06                              |
| GAMING AND LEISURE        |        |              |           |                                   | WAL MART STORES                  | 25.694 | USD          | 1.554.230          | 1,20                              |
| PROPERTIES                | 8.809  | USD          | 405.743   | 0,31                              | WASTE MAN                        | 2.033  | USD          | 433.070            | 0,34                              |
| GE HEALTHCARE             |        |              |           |                                   | WEST PHARMACEUTICAL              |        |              |                    |                                   |
| TECHNOLOGIES              | 6.082  | USD          | 551.516   | 0,43                              | SERVICES                         | 665    | USD          | 263.985            | 0,20                              |
| GENERAL DYNAMICS          | 4.217  | USD          | 1.191.049 | 0,92                              | WEYERHAEUSER                     | 3.952  | USD          | 142.153            | 0,11                              |
| GILEAD SCIENCES           | 14.005 | USD          | 1.030.768 | 0,80                              | WP CAREY REIT                    | 509    | USD          | 28.636             | 0,02                              |
| GRACO                     | 5.975  | USD          | 562.128   | 0,44                              | YUM BRANDS                       | 411    | USD          | 56.944             | 0,04                              |
| GRAINGER W W              | 1.181  | USD          | 1.207.561 | 0,94                              | ZIMMER HOLDINGS                  | 732    | USD          | 96.895             | 0,08                              |
| HOLOGIC                   | 8.496  | USD          | 658.143   | 0,51                              | ZOETIS                           | 5.589  | USD          | 953.428            | 0,74                              |
| INTUITIVE SURGICAL        | 1.170  | USD          | 468.503   | 0,36                              |                                  |        |              | <b>74.063.841</b>  | <b>57,35</b>                      |
| JOHNSON & JOHNSON         | 11.269 | USD          | 1.786.362 | 1,38                              | <b>SUMME AKTIEN</b>              |        |              | <b>125.557.889</b> | <b>97,23</b>                      |
| KIMBERLY-CLARK            | 4.170  | USD          | 538.430   | 0,42                              |                                  |        |              |                    |                                   |
| KNIGHT SWIFT              |        |              |           |                                   | <b>DEPOSITARY RECEIPTS</b>       |        |              |                    |                                   |
| TRANSPORTATION            |        |              |           |                                   |                                  |        |              |                    |                                   |
| HOLDINGS                  | 949    | USD          | 52.100    | 0,04                              | <b>NIEDERLANDE</b>               |        |              |                    |                                   |
| KROGER                    | 21.037 | USD          | 1.202.265 | 0,93                              | ABN AMRO GROUP                   | 13.323 | EUR          | 227.919            | 0,18                              |
| LENNAR                    | 4.223  | USD          | 728.130   | 0,56                              |                                  |        |              | <b>227.919</b>     | <b>0,18</b>                       |
| LIBERTY GLOBAL            | 543    | USD          | 9.606     | 0,01                              | <b>SUMME DEPOSITARY RECEIPTS</b> |        |              | <b>227.919</b>     | <b>0,18</b>                       |
| LOEWS                     | 6.264  | USD          | 490.596   | 0,38                              |                                  |        |              |                    |                                   |
| MANHATTAN ASSOCIATES      | 966    | USD          | 241.973   | 0,19                              | <b>VORZUGSAKTIEN</b>             |        |              |                    |                                   |
| MARKEL                    | 468    | USD          | 709.549   | 0,55                              |                                  |        |              |                    |                                   |
| MCDONALDS                 | 2.102  | USD          | 594.593   | 0,46                              | <b>BRASILIEN</b>                 |        |              |                    |                                   |
| MERCK & CO                | 12.838 | USD          | 1.691.920 | 1,31                              | CIA ENERGETICA MINAS             | 30.900 | BRL          | 78.461             | 0,06                              |
| MICROSOFT                 | 9.848  | USD          | 4.145.515 | 3,22                              |                                  |        |              | <b>78.461</b>      | <b>0,06</b>                       |
| NETAPP                    | 6.941  | USD          | 732.623   | 0,57                              | <b>KOLUMBIEN</b>                 |        |              |                    |                                   |
| NVIDIA                    | 3.168  | USD          | 2.876.386 | 2,23                              | BANCOLOMBIA                      | 15.213 | COP          | 129.410            | 0,10                              |
| PACCAR                    | 10.193 | USD          | 1.263.422 | 0,98                              |                                  |        |              | <b>129.410</b>     | <b>0,10</b>                       |
| PPL                       | 15.426 | USD          | 422.364   | 0,33                              | <b>DEUTSCHLAND</b>               |        |              |                    |                                   |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP | 7.844  | USD          | 676.702   | 0,52                              | HENKEL                           | 5.206  | EUR          | 420.112            | 0,33                              |
| PROCTER AND GAMBLE        | 8.001  | USD          | 1.298.082 | 1,01                              |                                  |        |              | <b>420.112</b>     | <b>0,33</b>                       |
| PUBLIC STORAGE            | 3.901  | USD          | 1.129.261 | 0,87                              | <b>SÜDKOREA</b>                  |        |              |                    |                                   |
| PULTE GROUP               | 7.226  | USD          | 871.889   | 0,68                              | SAMSUNG ELECTRONICS              | 24.334 | KRW          | 1.214.666          | 0,94                              |
| REGENERON PHARMS          | 1.282  | USD          | 1.239.091 | 0,96                              |                                  |        |              | <b>1.214.666</b>   | <b>0,94</b>                       |
|                           |        |              |           |                                   | <b>SUMME VORZUGSAKTIEN</b>       |        |              | <b>1.842.649</b>   | <b>1,43</b>                       |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Equity Volatility Focused (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl    | Wäh-<br>rung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>Vermögens |
|---|-----------|--------------|--------------------|------------------------------|
| <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN<br/>BÖRSE NOTIERTEN WERTPAPIERE<br/>WERTPAPIERE</b> |           |              | <b>127.628.457</b> | <b>98,84</b>                 |
| <b>AN EINEM ANDEREM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE, ÜBERTRAGBARE<br/>WERTPAPIERE</b>    |           |              |                    |                              |
| <b>AKTIEN</b>   |           |              |                    |                              |
| <b>KATAR</b>  |           |              |                    |                              |
| OOREDOO QSC   | 14.275    | QAR          | 41.559             | 0,03                         |
|   |           |              | <b>41.559</b>      | <b>0,03</b>                  |
| <b>SÜDKOREA</b>   |           |              |                    |                              |
| INDUSTRIAL BANK OF KOREA  | 9.186     | KRW          | 95.186             | 0,07                         |
|   |           |              | <b>95.186</b>      | <b>0,07</b>                  |
| <b>VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE</b>   |           |              |                    |                              |
| ABU DHABI COMMERCIAL<br>BANK  | 24.977    | AED          | 57.134             | 0,04                         |
|   |           |              | <b>57.134</b>      | <b>0,04</b>                  |
| <b>USA</b>  |           |              |                    |                              |
| ALPHABET  | 2.128     | USD          | 322.839            | 0,26                         |
|   |           |              | <b>322.839</b>     | <b>0,26</b>                  |
| <b>SUMME AKTIEN</b>   |           |              | <b>516.718</b>     | <b>0,40</b>                  |
| <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN<br/>MARKT GEHANDELTEN ÜBERTRAGBAREN WERTPAPIERE</b> |           |              | <b>516.718</b>     | <b>0,40</b>                  |
| <b>SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>  |           |              |                    |                              |
| <b>AKTIEN</b>   |           |              |                    |                              |
| <b>RUSSISCHE FÖDERATION</b>   |           |              |                    |                              |
| INTER RAO UES*  | 1.320.800 | RUB          | -                  | 0,00                         |
|   |           |              | <b>-</b>           | <b>0,00</b>                  |
| <b>SUMME AKTIEN</b>   |           |              | <b>-</b>           | <b>0,00</b>                  |
| <b>DEPOSITARY RECEIPTS</b>  |           |              |                    |                              |
| <b>NIEDERLANDE</b>  |           |              |                    |                              |
| X5 RETAIL GROUP*  | 4.312     | RUB          | -                  | 0,00                         |
|   |           |              | <b>-</b>           | <b>0,00</b>                  |
| <b>SUMME DEPOSITARY RECEIPTS</b>  |           |              | <b>-</b>           | <b>0,00</b>                  |
| <b>SUMME SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>                                      |           |              | <b>-</b>           | <b>0,00</b>                  |
| <b>SUMME WERTPAPIERANLAGEN</b>  |           |              | <b>128.145.175</b> | <b>99,24</b>                 |
| <b>SONSTIGES NETTOVERMÖGEN</b>  |           |              | <b>986.119</b>     | <b>0,76</b>                  |
| <b>GESAMTNETTOVERMÖGEN</b>  |           |              | <b>129.131.294</b> | <b>100,00</b>                |

\* Aufgrund der Marktgegebenheiten infolge der Ukraine- und Russland-Krise seit dem 25. Februar 2022 haben der Ausschuss für die Preisbestimmung und die Verwaltungsgesellschaft vereinbart und veranlasst, dass alle auf Rubel lautenden russischen Aktien im Anlageportfolio auf null abgeschrieben werden.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Brazil Equity  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl    | Wäh-<br>rung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens | Beschreibung  | Anzahl | Wäh-<br>rung     | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |
|---|-----------|--------------|--------------------|-----------------------------------|---|--------|------------------|-------------------|-----------------------------------|
| <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>  |           |              |                    |                                   | <b>GERDAU</b>   |        |                  |                   |                                   |
| <b>AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |           |              |                    |                                   | <b>ITAU INVESTIMENTOS</b>                                       |        |                  |                   |                                   |
| <b>AKTIEN</b>   |           |              |                    |                                   | <b>ITAU UNIBANCO BANCO MULTIPLIO</b>                            |        |                  |                   |                                   |
| <b>BRASILIEN</b>  |           |              |                    |                                   | <b>PETROBRAS</b>  |        |                  |                   |                                   |
| AMBEV   | 1.956.700 | BRL          | 4.866.781          | 3,28                              |   |        |                  | <b>37.998.581</b> | <b>25,64</b>                      |
| ATACADAO DISTRIBUICAO   |           |              |                    |                                   |   |        |                  | <b>37.998.581</b> | <b>25,64</b>                      |
| COMERCIO E INDUSTRIA LTDA   | 1.259.900 | BRL          | 3.453.332          | 2,33                              | <b>SUMME VORZUGSAKTIE</b>                                       |        |                  |                   |                                   |
| B3 SA BRASIL BOLSA BALCAO   | 2.819.669 | BRL          | 6.765.335          | 4,56                              | <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTEN WERTPAPIERE</b> |        |                  |                   |                                   |
| BANCO BTG PACTUAL   | 946.000   | BRL          | 6.996.418          | 4,72                              | <b>143.566.878</b>  |        |                  |                   |                                   |
| BANCO DO BRASIL   | 284.100   | BRL          | 3.222.095          | 2,17                              | <b>96,87</b>  |        |                  |                   |                                   |
| CENTRAIS ELECTRICAS   |           |              |                    |                                   | <b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>                        |        |                  |                   |                                   |
| BRASILEIRAS   | 386.000   | BRL          | 3.211.044          | 2,17                              | <b>DEUTSCHLAND</b>  |        |                  |                   |                                   |
| COSAN INDUSTRIA COMERCIO  | 844.500   | BRL          | 2.711.214          | 1,83                              | <b>ISHARES MSCI BRAZIL UCITS</b>                                |        |                  |                   |                                   |
| ENERGISA  | 283.100   | BRL          | 2.702.304          | 1,82                              | 34.244  | USD    | 1.362.398        | 0,92              |                                   |
| GPS PARTICIPACOES E EMPREENDIMENTOS                               | 625.200   | BRL          | 2.561.727          | 1,73                              |   |        | <b>1.362.398</b> | <b>0,92</b>       |                                   |
| HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS                             | 2.588.238 | BRL          | 1.944.197          | 1,31                              | <b>SUMME ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>                  |        |                  |                   |                                   |
| INTER & CO  | 308.346   | BRL          | 1.767.944          | 1,19                              | <b>1.362.398</b>  |        |                  |                   |                                   |
| JBS   | 296.700   | BRL          | 1.287.436          | 0,87                              | <b>1.362.398</b>  |        |                  |                   |                                   |
| KLABIN  | 180.700   | BRL          | 903.581            | 0,61                              | <b>144.929.276</b>  |        |                  |                   |                                   |
| LOCALIZA RENT A CAR   | 474.165   | BRL          | 5.212.874          | 3,52                              | <b>97,79</b>  |        |                  |                   |                                   |
| LOJAS RENNER  | 504.110   | BRL          | 1.709.052          | 1,15                              | <b>SUMME WERTPAPIERANLAGEN</b>                                  |        |                  |                   |                                   |
| NATURA & CO HOLDINGS  | 374.800   | BRL          | 1.347.784          | 0,91                              | <b>148.204.136</b>  |        |                  |                   |                                   |
| NU HOLDINGS   | 170.906   | USD          | 2.049.163          | 1,38                              | <b>100,00</b>   |        |                  |                   |                                   |
| PETRO RIO   | 594.200   | BRL          | 5.749.040          | 3,88                              | <b>SONSTIGES NETTOVERMÖGEN</b>                                  |        |                  |                   |                                   |
| PETROBRAS   | 342.800   | BRL          | 2.610.609          | 1,76                              | <b>2,21</b>   |        |                  |                   |                                   |
| RAIA DROGASIL   | 226.744   | BRL          | 1.242.085          | 0,84                              | <b>103.203.663</b>  |        |                  |                   |                                   |
| REDE D'OR SAO LUIZ  | 693.100   | BRL          | 3.517.044          | 2,37                              | <b>69,63</b>  |        |                  |                   |                                   |
| SABESP ON   | 331.900   | BRL          | 5.642.012          | 3,81                              | <b>2.364.634</b>  |        |                  |                   |                                   |
| SUZANO PAPEL E CELULOSE   | 460.900   | BRL          | 5.889.296          | 3,97                              | <b>1,60</b>   |        |                  |                   |                                   |
| TIM SA/BRAZIL   | 814.900   | BRL          | 2.883.175          | 1,95                              | <b>105.568.297</b>  |        |                  |                   |                                   |
| TOTVS   | 777.200   | BRL          | 4.406.496          | 2,97                              | <b>71,23</b>  |        |                  |                   |                                   |
| VALE  | 851.233   | BRL          | 10.312.307         | 6,97                              | <b>SUMME AKTIEN</b>   |        |                  |                   |                                   |
| VIBRA ENERGIA   | 265.400   | BRL          | 1.331.891          | 0,90                              | <b>105.568.297</b>  |        |                  |                   |                                   |
| WEG   | 899.700   | BRL          | 6.907.427          | 4,66                              | <b>71,23</b>  |        |                  |                   |                                   |
|   |           |              | <b>103.203.663</b> | <b>69,63</b>                      | <b>VORZUGSAKTIE</b>   |        |                  |                   |                                   |
| <b>USA</b>  |           |              |                    |                                   | <b>BRASILIEN</b>  |        |                  |                   |                                   |
| MERCADOLIBRE  | 1.561     | USD          | 2.364.634          | 1,60                              | <b>BANCO BRADESCO</b>   |        |                  |                   |                                   |
|   |           |              | <b>2.364.634</b>   | <b>1,60</b>                       | <b>3.027.314</b>  |        |                  |                   |                                   |
|   |           |              | <b>105.568.297</b> | <b>71,23</b>                      | <b>CENTRAIS ELECTRICAS</b>                                      |        |                  |                   |                                   |
|   |           |              |                    |                                   | <b>BRASILEIRAS „B“</b>  |        |                  |                   |                                   |
|   |           |              |                    |                                   | <b>514.300</b>  |        |                  |                   |                                   |
|   |           |              |                    |                                   | <b>BRL</b>  |        |                  |                   |                                   |
|   |           |              |                    |                                   | <b>4.773.577</b>  |        |                  |                   |                                   |
|   |           |              |                    |                                   | <b>3,22</b>   |        |                  |                   |                                   |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Economic Scale US Equity  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl | Wäh-<br>rung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens | Beschreibung                 | Anzahl | Wäh-<br>rung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |
|---|--------|--------------|------------------|-----------------------------------|------------------------------|--------|--------------|------------------|-----------------------------------|
| <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>  |        |              |                  |                                   |                              |        |              |                  |                                   |
| <b>AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |        |              |                  |                                   |                              |        |              |                  |                                   |
| <b>AKTIEN</b>   |        |              |                  |                                   |                              |        |              |                  |                                   |
| <b>KANADA</b>   |        |              |                  |                                   |                              |        |              |                  |                                   |
| LIONS GATE ENTERTAINMENT  | 8.599  | USD          | 87.194           | 0,03                              | DELPHI AUTOMOTIVE CORP       | 7.102  | USD          | 562.052          | 0,21                              |
| MASONITE INTERNATIONAL CORP                                       | 497    | USD          | 65.346           | 0,02                              | FERGUSON NEWCO               | 1.300  | USD          | 285.357          | 0,11                              |
| PROGRESSIVE WASTE CONNECTIONS                                     | 854    | USD          | 147.297          | 0,06                              |                              |        |              | <b>1.072.671</b> | <b>0,40</b>                       |
|   |        |              | <b>299.837</b>   | <b>0,11</b>                       | <b>LIBERIA</b>               |        |              |                  |                                   |
|   |        |              |                  |                                   | ROYAL CARIBBEAN CRUISES      | 431    | USD          | 59.732           | 0,02                              |
|   |        |              |                  |                                   |                              |        |              | <b>59.732</b>    | <b>0,02</b>                       |
|   |        |              |                  |                                   | <b>NIEDERLANDE</b>           |        |              |                  |                                   |
|   |        |              |                  |                                   | FRANKS INTERNATIONAL         | 299    | USD          | 5.986            | 0,00                              |
|   |        |              |                  |                                   | NXP SEMICONDUCTORS           | 1.436  | USD          | 355.597          | 0,14                              |
|   |        |              |                  |                                   |                              |        |              | <b>361.583</b>   | <b>0,14</b>                       |
|   |        |              |                  |                                   | <b>SINGAPUR</b>              |        |              |                  |                                   |
|   |        |              |                  |                                   | FLEXTRONICS INTERNATIONAL    | 27.648 | USD          | 789.350          | 0,30                              |
|   |        |              |                  |                                   |                              |        |              | <b>789.350</b>   | <b>0,30</b>                       |
|   |        |              |                  |                                   | <b>SCHWEIZ</b>               |        |              |                  |                                   |
| <b>CHINA</b>  |        |              |                  |                                   | ACE                          | 1.541  | USD          | 398.009          | 0,15                              |
| SIGNET JEWELERS   | 961    | USD          | 95.245           | 0,04                              | BUNGE GLOBAL                 | 1.211  | USD          | 125.351          | 0,05                              |
|   |        |              | <b>95.245</b>    | <b>0,04</b>                       | GARMIN                       | 770    | USD          | 114.453          | 0,04                              |
|   |        |              |                  |                                   | T E CONNECTIVITY             | 2.392  | USD          | 347.749          | 0,13                              |
|   |        |              |                  |                                   |                              |        |              | <b>985.562</b>   | <b>0,37</b>                       |
|   |        |              |                  |                                   | <b>USA</b>                   |        |              |                  |                                   |
| <b>GROSSBRITANNIEN</b>  |        |              |                  |                                   | 3M CO                        | 6.492  | USD          | 685.101          | 0,26                              |
| CAPRI HOLDINGS  | 1.601  | USD          | 73.198           | 0,03                              | AARON'S                      | 4.203  | USD          | 31.480           | 0,01                              |
| CUSHMAN AND WAKEFIELD   | 26.752 | USD          | 284.373          | 0,10                              | ABBOTT LABORATORIES          | 8.278  | USD          | 936.159          | 0,35                              |
| GATES INDUSTRIAL  | 5.575  | USD          | 98.845           | 0,04                              | ABBVIE                       | 7.291  | USD          | 1.322.660        | 0,50                              |
| JANUS HENDERSON GROUP   | 2.268  | USD          | 75.207           | 0,03                              | ABERCROMBIE & FITCH          | 1.383  | USD          | 171.630          | 0,06                              |
| NOBLE CORP  | 725    | USD          | 35.126           | 0,01                              | ABM INDUSTRIES               | 11.293 | USD          | 506.943          | 0,19                              |
| ROIVANT SCIENCES  | 2.736  | USD          | 28.728           | 0,01                              | ACADEMY SPORTS & OUTDOORS    | 1.645  | USD          | 110.429          | 0,04                              |
| ROYALTY PHARMA  | 3.200  | USD          | 98.016           | 0,04                              | ACADIA HEALTHCARE            | 1.073  | USD          | 84.799           | 0,03                              |
| SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING                                      | 2.530  | USD          | 92.750           | 0,03                              | ACCO BRANDS                  | 5.565  | USD          | 31.442           | 0,01                              |
| TRONOX HOLDINGS   | 2.732  | USD          | 48.766           | 0,02                              | ACI WORLDWIDE                | 526    | USD          | 17.495           | 0,01                              |
|   |        |              | <b>835.009</b>   | <b>0,31</b>                       | ACUITY BRANDS                | 315    | USD          | 84.458           | 0,03                              |
|   |        |              |                  |                                   | ACUSHNET HOLDINGS CORP       | 536    | USD          | 35.526           | 0,01                              |
|   |        |              |                  |                                   | ADDUS HOMECARE               | 1.094  | USD          | 113.820          | 0,04                              |
| <b>IRLAND</b>   |        |              |                  |                                   | ADOBE SYSTEMS                | 505    | USD          | 253.833          | 0,10                              |
| ACCENTURE CORP  | 7.085  | USD          | 2.430.509        | 0,91                              | ADT INC                      | 27.662 | USD          | 185.474          | 0,07                              |
| ALLEGION  | 535    | USD          | 72.172           | 0,03                              | ADTALEM GLOBAL               |        |              |                  |                                   |
| AON PLC IRELAND   | 1.260  | USD          | 421.508          | 0,16                              | EDUCATION                    | 225    | USD          | 11.682           | 0,00                              |
| CIMPRESS  | 693    | USD          | 61.892           | 0,02                              | ADVANCE AUTO PARTS           | 3.879  | USD          | 332.159          | 0,13                              |
| JAZZ PHARMACEUTICALS  | 275    | USD          | 33.124           | 0,01                              | ADVANCED DRAINAGE SYSTEMS    | 226    | USD          | 39.279           | 0,01                              |
| JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL                                    | 10.917 | USD          | 709.605          | 0,27                              | ADVANCED ENERGY INDUSTRIES   | 358    | USD          | 36.670           | 0,01                              |
| MEDTRONIC   | 9.290  | USD          | 808.695          | 0,30                              | ADVANCED MICRO DEVICES       | 1.384  | USD          | 252.054          | 0,09                              |
| NEW LINDE   | 1.809  | USD          | 839.050          | 0,32                              | AECOM TECHNOLOGY             | 3.238  | USD          | 318.878          | 0,12                              |
| NVENT ELECTRIC  | 779    | USD          | 58.783           | 0,02                              | AES                          | 1.845  | USD          | 32.564           | 0,01                              |
| PENTAIR   | 795    | USD          | 68.084           | 0,03                              | AFFILIATED MANAGERS          | 597    | USD          | 100.039          | 0,04                              |
| PERRIGO   | 1.994  | USD          | 63.549           | 0,02                              | AFLAC                        | 2.450  | USD          | 210.406          | 0,08                              |
| SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS                                       | 3.111  | USD          | 288.981          | 0,11                              | AGCO                         | 994    | USD          | 121.646          | 0,05                              |
| STERIS  | 354    | USD          | 79.632           | 0,03                              | AGILENT TECHNOLOGIES         | 851    | USD          | 124.357          | 0,05                              |
| TRANE TECHNOLOGIES  | 954    | USD          | 285.847          | 0,11                              | AIR PRODUCTS & CHEMICALS     | 624    | USD          | 150.690          | 0,06                              |
| WEATHERFORD INTERNATIONAL   | 1.196  | USD          | 140.817          | 0,05                              | AIR TRANSPORT SERVICES GROUP | 1.776  | USD          | 25.290           | 0,01                              |
| WILLIS TOWERS WATSON  | 1.143  | USD          | 315.359          | 0,12                              |                              |        |              |                  |                                   |
|   |        |              | <b>6.677.607</b> | <b>2,51</b>                       |                              |        |              |                  |                                   |
|   |        |              |                  |                                   |                              |        |              |                  |                                   |
| <b>JERSEY</b>   |        |              |                  |                                   |                              |        |              |                  |                                   |
| AMCOR   | 22.267 | USD          | 212.427          | 0,08                              |                              |        |              |                  |                                   |
| CLARIVATE   | 1.709  | USD          | 12.835           | 0,00                              |                              |        |              |                  |                                   |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Economic Scale US Equity (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung                              | Anzahl | Wäh-<br>rung | Kurswert  | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens | Beschreibung                         | Anzahl  | Wäh-<br>rung | Kurswert  | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |
|---|--------|--------------|-----------|-----------------------------------|--------------------------------------|---------|--------------|-----------|-----------------------------------|
| AIRBNB                                    | 344    | USD          | 56.925    | 0,02                              | APARTMENT INCOME REIT                | 569     | USD          | 18.390    | 0,01                              |
| AKAMAI TECHNOLOGIES                       | 687    | USD          | 74.828    | 0,03                              | API GROUP                            | 909     | USD          | 36.215    | 0,01                              |
| ALASKA AIR GROUP                          | 3.954  | USD          | 170.180   | 0,06                              | APOGEE ENTERPRISES                   | 528     | USD          | 31.485    | 0,01                              |
| ALBANY INTERNATIONAL „A“                  | 133    | USD          | 12.482    | 0,00                              | APPLE                                | 27.855  | USD          | 4.766.268 | 1,80                              |
| ALBEMARLE                                 | 102    | USD          | 13.241    | 0,00                              | APPLIED MATERIALS                    | 2.251   | USD          | 462.783   | 0,17                              |
| ALBERTSONS COS                            | 36.203 | USD          | 774.744   | 0,29                              | APTARGROUP                           | 559     | USD          | 80.926    | 0,03                              |
| ALIGN TECHNOLOGY                          | 241    | USD          | 78.699    | 0,03                              | ARAMARK HOLDINGS                     | 7.163   | USD          | 232.404   | 0,09                              |
| ALLEGHENY TECHNOLOGIES                    | 939    | USD          | 48.255    | 0,02                              | ARCBEST                              | 544     | USD          | 77.063    | 0,03                              |
| ALLIANCE DATA SYSTEMS                     | 1.443  | USD          | 54.574    | 0,02                              | ARCH CAPITAL GROUP                   | 448     | USD          | 41.131    | 0,02                              |
| ALLISON TRANSMISSION<br>HOLDING           | 913    | USD          | 74.218    | 0,03                              | ARCH RESOURCES                       | 115     | USD          | 18.642    | 0,01                              |
| ALLSCRIPTS HEALTHCARE<br>SOLUTIONS        | 5.740  | USD          | 43.624    | 0,02                              | ARCHER DANIELS MIDLAND               | 3.095   | USD          | 194.985   | 0,07                              |
| ALLSTATE                                  | 2.808  | USD          | 485.447   | 0,18                              | ARCONIC                              | 2.720   | USD          | 185.939   | 0,07                              |
| ALLY FINANCIAL                            | 4.579  | USD          | 184.946   | 0,07                              | ARCOSA                               | 333     | USD          | 28.894    | 0,01                              |
| ALPHA METALLURGICAL<br>RESSOURCEN         | 74     | USD          | 24.299    | 0,01                              | ARES MANAGEMENT                      | 741     | USD          | 98.805    | 0,04                              |
| ALPHABET „A“                              | 22.394 | USD          | 3.369.400 | 1,28                              | ARISTA NETWORKS                      | 99      | USD          | 28.853    | 0,01                              |
| ALTICE USA                                | 88.865 | USD          | 230.605   | 0,09                              | ARMSTRONG WORLD<br>INDUSTRIES        | 331     | USD          | 41.342    | 0,02                              |
| ALTRIA GROUP                              | 9.489  | USD          | 415.049   | 0,16                              | ARROW ELECTRONIC                     | 807     | USD          | 104.507   | 0,04                              |
| AMAZON.COM                                | 28.617 | USD          | 5.168.802 | 1,96                              | ARTISAN PARTNERS ASSET<br>MANAGEMENT | 865     | USD          | 39.652    | 0,01                              |
| AMC ENTERTAINMENT<br>HOLDINGS             | 18.694 | USD          | 68.700    | 0,03                              | ASBURY AUTOMOTIVE<br>GROUP           | 136     | USD          | 32.161    | 0,01                              |
| AMC NETWORKS                              | 892    | USD          | 10.900    | 0,00                              | ASGN                                 | 310     | USD          | 32.538    | 0,01                              |
| AMERCO                                    | 312    | USD          | 20.620    | 0,01                              | ASHLAND GLOBAL HOLDINGS              | 641     | USD          | 62.856    | 0,02                              |
| AMEREN                                    | 515    | USD          | 37.827    | 0,01                              | ASSOCIATED BAN-CORP                  | 1.759   | USD          | 37.871    | 0,01                              |
| AMERICAN AIRLINES GROUP                   | 41.484 | USD          | 638.231   | 0,24                              | ASSURANT                             | 570     | USD          | 107.171   | 0,04                              |
| AMERICAN AXLE &<br>VERARBEITENDES GEWERBE | 11.063 | USD          | 81.866    | 0,03                              | AT&T                                 | 160.587 | USD          | 2.821.513 | 1,06                              |
| AMERICAN EAGLE<br>OUTFITTERS              | 5.993  | USD          | 154.559   | 0,06                              | ATKORE INTERNATIONAL<br>GROUP        | 77      | USD          | 14.502    | 0,01                              |
| AMERICAN ELECTRIC POWER                   | 1.018  | USD          | 87.283    | 0,03                              | ATLANTA BRAVES HOLDINGS              | 27      | USD          | 1.059     | 0,00                              |
| AMERICAN EXPRESS                          | 3.314  | USD          | 752.609   | 0,28                              | ATLISSIAN                            | 276     | USD          | 53.933    | 0,02                              |
| AMERICAN FINANCIAL GROUP                  | 664    | USD          | 91.008    | 0,03                              | AUTODESK                             | 375     | USD          | 98.085    | 0,04                              |
| AMERICAN INTERNATIONAL<br>GROUP           | 5.463  | USD          | 428.299   | 0,16                              | AUTOLIV                              | 2.608   | USD          | 316.037   | 0,12                              |
| AMERICAN TOWER                            | 592    | USD          | 116.861   | 0,04                              | AUTOMATIC DATA<br>PROCESSING         | 1.993   | USD          | 498.071   | 0,19                              |
| AMERICAN WATER WORKS                      | 291    | USD          | 35.391    | 0,01                              | AUTONATION                           | 935     | USD          | 157.136   | 0,06                              |
| AMERICAN WOODMARK                         | 540    | USD          | 55.134    | 0,02                              | AUTOZONE                             | 146     | USD          | 462.750   | 0,17                              |
| AMERIPRISE FINANCIAL                      | 491    | USD          | 216.168   | 0,08                              | AVALONBAY COMMUNITIES                | 404     | USD          | 75.124    | 0,03                              |
| AMERISOURCEBERGEN                         | 468    | USD          | 112.676   | 0,04                              | AVANTOR                              | 2.471   | USD          | 63.208    | 0,02                              |
| AMETEK                                    | 653    | USD          | 119.656   | 0,05                              | AVERY DENNISON                       | 794     | USD          | 178.197   | 0,07                              |
| AMGEN                                     | 2.786  | USD          | 797.688   | 0,30                              | AVIENT CORPORATION                   | 777     | USD          | 33.924    | 0,01                              |
| AMKOR TECHNOLOGY                          | 4.417  | USD          | 144.303   | 0,05                              | AVIS BUDGET GROUP                    | 1.115   | USD          | 137.591   | 0,05                              |
| AMPHENOL                                  | 3.984  | USD          | 461.626   | 0,17                              | AVNET                                | 1.399   | USD          | 69.237    | 0,03                              |
| ANALOG DEVICES                            | 1.739  | USD          | 344.992   | 0,13                              | AXALTA COATING SYSTEMS               | 2.333   | USD          | 80.232    | 0,03                              |
| ANGI HOMESERVICES                         | 8.200  | USD          | 21.402    | 0,01                              | AXIS CAPITAL HOLDINGS                | 483     | USD          | 31.381    | 0,01                              |
| ANNALY CAPITAL<br>MANAGEMENT              | 1.702  | USD          | 33.325    | 0,01                              | BAKER HUGHES                         | 10.789  | USD          | 361.432   | 0,14                              |
| ANSYS                                     | 97     | USD          | 33.707    | 0,01                              | BALL                                 | 2.358   | USD          | 159.802   | 0,06                              |
| ANTERO RESOURCES CORP                     | 2.702  | USD          | 78.412    | 0,03                              | BANK OF AMERICA                      | 85.049  | USD          | 3.207.197 | 1,22                              |
| ANTHEM                                    | 1.255  | USD          | 653.228   | 0,25                              | BANK OF CALIFORNIA                   | 1.029   | USD          | 15.805    | 0,01                              |
| AO SMITH                                  | 1.053  | USD          | 93.801    | 0,04                              | BANK OF NEW YORK MELLON              | 9.385   | USD          | 540.951   | 0,20                              |
| APA                                       | 5.130  | USD          | 175.651   | 0,07                              | BANKUNITED                           | 515     | USD          | 14.528    | 0,01                              |
|   |        |              |           |                                   | BARNES GROUP                         | 372     | USD          | 13.991    | 0,01                              |
|   |        |              |           |                                   | BARRETT BUSINESS<br>SERVICES         | 329     | USD          | 41.793    | 0,02                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Economic Scale US Equity (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung                    | Anzahl | Währung | Kurswert  | % des Nettovermögens | Beschreibung                  | Anzahl | Währung | Kurswert  | % des Nettovermögens |
|---------------------------------|--------|---------|-----------|----------------------|-------------------------------|--------|---------|-----------|----------------------|
| BAXTER INTERNATIONAL            | 6.602  | USD     | 281.575   | 0,11                 | CACI INTERNATIONAL „A“        | 296    | USD     | 112.729   | 0,04                 |
| BEACON ROOFING SUPPLY           | 343    | USD     | 33.556    | 0,01                 | CADENCE BANK                  | 1.451  | USD     | 42.297    | 0,02                 |
| BECTON DICKINSON                | 1.218  | USD     | 300.809   | 0,11                 | CADENCE DESIGN SYSTEM         | 150    | USD     | 46.764    | 0,02                 |
| BELDEN CDT                      | 598    | USD     | 55.805    | 0,02                 | CAESARS ENTERTAINMENT         | 1.804  | USD     | 78.853    | 0,03                 |
| BELLRING DISTRIBUTION           | 268    | USD     | 16.088    | 0,01                 | CALERES                       | 1.134  | USD     | 46.279    | 0,02                 |
| BENCHMARK ELECTRONICS           | 1.926  | USD     | 58.069    | 0,02                 | CALIFORNIA RESOURCES          | 617    | USD     | 33.941    | 0,01                 |
| BERKSHIRE HATHAWAY „B“          | 7.375  | USD     | 3.074.415 | 1,16                 | CALLAWAY GOLF                 | 3.475  | USD     | 56.643    | 0,02                 |
| BERRY PLASTICS GROUP            | 2.825  | USD     | 171.336   | 0,06                 | CALLON PETROLEUM              | 354    | USD     | 12.631    | 0,00                 |
| BEST BUY                        | 5.779  | USD     | 477.519   | 0,18                 | CAMPBELL SOUP                 | 2.254  | USD     | 100.427   | 0,04                 |
| BGC GROUP                       | 10.356 | USD     | 80.000    | 0,03                 | CAMPING WORLD HOLDINGS        | 842    | USD     | 23.816    | 0,01                 |
| BIOGEN IDEC                     | 1.131  | USD     | 243.640   | 0,09                 | CAPITAL ONE FINANCIAL         | 4.825  | USD     | 717.429   | 0,27                 |
| BIO-RAD LABORATORIES            | 173    | USD     | 59.856    | 0,02                 | CARDINAL HEALTH               | 2.467  | USD     | 275.441   | 0,10                 |
| BJS WHOLESALE CLUB HOLDINGS     | 1.487  | USD     | 113.131   | 0,04                 | CARLISLEPANIES                | 256    | USD     | 100.613   | 0,04                 |
| BLACKROCK                       | 658    | USD     | 550.789   | 0,21                 | CARLYLE GROUP                 | 2.226  | USD     | 105.201   | 0,04                 |
| BLACKSTONE GROUP                | 3.412  | USD     | 447.859   | 0,17                 | CARMAX                        | 229    | USD     | 19.953    | 0,01                 |
| BLOOMIN BRANDS                  | 2.742  | USD     | 79.079    | 0,03                 | CARNIVAL (PA1436583006)       | 4.857  | USD     | 81.063    | 0,03                 |
| BLUE OWL CAPITAL                | 1.211  | USD     | 23.166    | 0,01                 | CARPENTER TECHNOLOGY          | 363    | USD     | 25.838    | 0,01                 |
| BOEING                          | 2.508  | USD     | 482.640   | 0,18                 | CARRIER GLOBAL                | 7.524  | USD     | 435.489   | 0,16                 |
| BOISE CASCADE                   | 1.981  | USD     | 306.243   | 0,12                 | CARTERS                       | 859    | USD     | 72.989    | 0,03                 |
| BOK FINANCIAL                   | 303    | USD     | 27.715    | 0,01                 | CASEY'S GENERAL STORES        | 358    | USD     | 113.937   | 0,04                 |
| BOOKING HOLDINGS                | 100    | USD     | 365.408   | 0,14                 | CATALENT                      | 402    | USD     | 22.757    | 0,01                 |
| BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING     | 981    | USD     | 146.552   | 0,06                 | CATERPILLAR                   | 2.970  | USD     | 1.084.406 | 0,41                 |
| BORGWARNER                      | 5.708  | USD     | 198.353   | 0,07                 | CBIZ                          | 433    | USD     | 34.406    | 0,01                 |
| BOSTON PROPERTIES               | 463    | USD     | 30.132    | 0,01                 | CBOE HOLDINGS                 | 201    | USD     | 36.612    | 0,01                 |
| BOSTON SCIENTIFIC               | 2.601  | USD     | 178.663   | 0,07                 | CBRE GROUP                    | 6.259  | USD     | 611.755   | 0,23                 |
| BOYD GAMING                     | 668    | USD     | 45.050    | 0,02                 | CDW                           | 317    | USD     | 82.128    | 0,03                 |
| BRADY „A“                       | 509    | USD     | 30.515    | 0,01                 | CELANESE „A“                  | 607    | USD     | 103.742   | 0,04                 |
| BRIGHT HORIZONS FAMILY SOLUTION | 1.012  | USD     | 115.115   | 0,04                 | CENTENE                       | 3.751  | USD     | 294.416   | 0,11                 |
| BRIGHTSPHERE INVESTMENT GROUP   | 1.823  | USD     | 41.838    | 0,02                 | CENTERPOINT ENERGY            | 2.090  | USD     | 59.429    | 0,02                 |
| BRIGHTVIEW HOLDINGS             | 10.913 | USD     | 125.445   | 0,05                 | CERIDIAN HCM HOLDING          | 351    | USD     | 23.208    | 0,01                 |
| BRINKER INTERNATIONAL           | 1.706  | USD     | 85.402    | 0,03                 | CF INDUSTRIES HOLDINGS        | 1.462  | USD     | 120.761   | 0,05                 |
| BRINK'S                         | 2.104  | USD     | 196.156   | 0,07                 | CH ROBINSON WORLDWIDE         | 1.160  | USD     | 87.696    | 0,03                 |
| BRISTOL MYERS SQUIBB            | 15.734 | USD     | 850.895   | 0,32                 | CHAMPIONX CORP                | 703    | USD     | 25.533    | 0,01                 |
| BRIXMOR PROPERTY GROUP          | 1.617  | USD     | 37.967    | 0,01                 | CHARLES RIVER LABORATORIES    | 275    | USD     | 74.462    | 0,03                 |
| BROADCOM CORP                   | 1.742  | USD     | 2.306.408 | 0,87                 | CHARLES SCHWAB                | 5.545  | USD     | 400.460   | 0,15                 |
| BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS  | 374    | USD     | 76.689    | 0,03                 | CHARTER COMMUNICATIONS „A“    | 3.011  | USD     | 866.084   | 0,33                 |
| BROOKDALE SENIOR LIVING         | 27.610 | USD     | 183.468   | 0,07                 | CHEESECAKE FACTORY            | 1.305  | USD     | 47.502    | 0,02                 |
| BROWN & BROWN                   | 1.098  | USD     | 96.492    | 0,04                 | CHEMED                        | 64     | USD     | 41.106    | 0,02                 |
| BROWN-FORMAN „B“                | 869    | USD     | 44.997    | 0,02                 | CHEMIERE ENERGY               | 535    | USD     | 85.868    | 0,03                 |
| BRUKER BIOSCIENCES              | 571    | USD     | 53.548    | 0,02                 | CHESAPEAKE ENERGY             | 1.095  | USD     | 97.324    | 0,04                 |
| BRUNSWICK                       | 841    | USD     | 80.980    | 0,03                 | CHEVRON                       | 14.254 | USD     | 2.244.150 | 0,84                 |
| BUCKLE                          | 418    | USD     | 16.737    | 0,01                 | CHEWY                         | 1.334  | USD     | 21.331    | 0,01                 |
| BUILDERS FIRSTSOURCE            | 731    | USD     | 153.627   | 0,06                 | CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE   | 706    | USD     | 152.362   | 0,06                 |
| BURLINGTON STORES               | 816    | USD     | 189.508   | 0,07                 | CHILDRENS PLACE RETAIL STORES | 802    | USD     | 9.271     | 0,00                 |
| BWX TECHNOLOGIES                | 408    | USD     | 41.979    | 0,02                 | CHIPOTLE MEXIAN GRIL          | 55     | USD     | 161.102   | 0,06                 |
| CABOT                           | 473    | USD     | 43.601    | 0,02                 | CHORD ENERGY                  | 211    | USD     | 37.436    | 0,01                 |
| CABOT OIL & GAS                 | 6.004  | USD     | 167.392   | 0,06                 | CHURCH & DWIGHT               | 404    | USD     | 42.020    | 0,02                 |
|                                 |        |         |           |                      | CIENA                         | 855    | USD     | 42.895    | 0,02                 |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Economic Scale US Equity (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung                     | Anzahl | Währung | Kurswert  | % des Nettovermögens | Beschreibung                | Anzahl  | Währung | Kurswert  | % des Nettovermögens |
|----------------------------------|--------|---------|-----------|----------------------|-----------------------------|---------|---------|-----------|----------------------|
| CINCINNATI FINANCE               | 592    | USD     | 73.041    | 0,03                 | CROWN CASTLE REIT           | 1.432   | USD     | 151.806   | 0,06                 |
| CINEMARK HOLDINGS                | 586    | USD     | 10.472    | 0,00                 | CROWN HOLDING               | 1.615   | USD     | 127.811   | 0,05                 |
| CINTAS                           | 316    | USD     | 217.127   | 0,08                 | CSG SYSTEM INTERNATIONAL    | 585     | USD     | 30.139    | 0,01                 |
| CISCO SYSTEMS                    | 28.516 | USD     | 1.430.933 | 0,54                 | CSX                         | 10.851  | USD     | 401.650   | 0,15                 |
| CITIGROUP                        | 37.277 | USD     | 2.349.568 | 0,88                 | CULLEN-FROST BANKERS        | 329     | USD     | 36.996    | 0,01                 |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP         | 4.779  | USD     | 172.331   | 0,06                 | CUMMINS                     | 1.546   | USD     | 455.282   | 0,17                 |
| CIVITAS RESOURCES                | 405    | USD     | 30.804    | 0,01                 | CURTISS WRIGHT              | 213     | USD     | 54.475    | 0,02                 |
| CLEAN HARBORS                    | 308    | USD     | 62.385    | 0,02                 | CVR ENERGY                  | 1.030   | USD     | 36.699    | 0,01                 |
| CLEAR CHANNEL OUTDOOR HOLDINGS   | 9.926  | USD     | 16.428    | 0,01                 | CVS CAREMARK                | 15.353  | USD     | 1.224.555 | 0,46                 |
| CLEARWAY ENERGY                  | 2.279  | USD     | 51.802    | 0,02                 | DANA HOLDING                | 10.808  | USD     | 138.342   | 0,05                 |
| CLEVELAND CLIFFS                 | 6.883  | USD     | 155.797   | 0,06                 | DANAHER                     | 1.301   | USD     | 324.391   | 0,12                 |
| CMS ENERGY                       | 498    | USD     | 29.875    | 0,01                 | DARDEN RESTAURANTS          | 1.044   | USD     | 174.839   | 0,07                 |
| CNO FINANCIAL GROUP              | 1.192  | USD     | 32.935    | 0,01                 | DARLING INTERNATIONAL       | 1.072   | USD     | 50.020    | 0,02                 |
| COCA-COLA BOTTLING               | 91     | USD     | 76.167    | 0,03                 | DAVITA HEALTHCARE           |         |         |           |                      |
| COCA-COLA (US1912161007)         | 13.554 | USD     | 828.082   | 0,31                 | PARTNERS                    | 3.040   | USD     | 418.882   | 0,16                 |
| COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS   | 18.190 | USD     | 1.339.875 | 0,50                 | DECKERS OUTDOOR             | 23      | USD     | 21.799    | 0,01                 |
| COHERENT CORP                    | 1.429  | USD     | 87.755    | 0,03                 | DEERE                       | 1.264   | USD     | 517.077   | 0,19                 |
| COLGATE-PALMOLIVE                | 3.595  | USD     | 323.298   | 0,12                 | DELL TECHNOLOGIES           | 10.695  | USD     | 1.222.759 | 0,46                 |
| COLUMBIA BANKING SYSTEM          | 2.120  | USD     | 40.948    | 0,02                 | DELTA AIR LINES             | 16.313  | USD     | 780.903   | 0,29                 |
| COLUMBIA SPORTSWEAR              | 630    | USD     | 50.948    | 0,02                 | DELUXE                      | 1.828   | USD     | 37.840    | 0,01                 |
| COMCAST                          | 43.436 | USD     | 1.881.865 | 0,71                 | DENTSPLY SIRONA             | 2.665   | USD     | 88.438    | 0,03                 |
| COMERICA                         | 2.007  | USD     | 109.903   | 0,04                 | DESIGNER BRANDS             | 3.635   | USD     | 38.967    | 0,01                 |
| COMFORT SYSTEMS                  | 181    | USD     | 57.806    | 0,02                 | DEVON ENERGY                | 5.480   | USD     | 273.671   | 0,10                 |
| COMMERCE BANCSHARES              | 812    | USD     | 43.336    | 0,02                 | DIAMONDBACK ENERGY          | 705     | USD     | 139.280   | 0,05                 |
| COMMERCIAL METALS                | 1.193  | USD     | 69.910    | 0,03                 | DICK'S SPORTING GOODS       | 1.143   | USD     | 255.129   | 0,10                 |
| COMMSCOPE HOLDING                | 41.581 | USD     | 54.471    | 0,02                 | DIGITAL REALTY TRUST REIT   | 527     | USD     | 76.125    | 0,03                 |
| COMMUNITY HEALTH SYSTEMS         | 98.238 | USD     | 342.359   | 0,13                 | DIGITALBRIDGE GROUP         | 3.351   | USD     | 65.143    | 0,02                 |
| COMPASS MINERALS INTERNATIONAL   | 382    | USD     | 6.116     | 0,00                 | DILLARDS „A“                | 311     | USD     | 143.041   | 0,05                 |
| COMSTOCK RESOURCES               | 2.818  | USD     | 26.038    | 0,01                 | DIODES                      | 407     | USD     | 28.787    | 0,01                 |
| CONAGRA FOODS                    | 3.938  | USD     | 116.840   | 0,04                 | DISCOVER FINANCIAL SERVICES | 2.128   | USD     | 277.981   | 0,10                 |
| CONCENTRIX                       | 14.248 | USD     | 933.386   | 0,35                 | DISCOVERY                   | 103.323 | USD     | 901.493   | 0,34                 |
| CONOCOPHILLIPS                   | 8.010  | USD     | 1.020.314 | 0,38                 | DOCUSIGN                    | 508     | USD     | 30.363    | 0,01                 |
| CONS EDISON                      | 949    | USD     | 85.695    | 0,03                 | DOLBY LABORATORIES „A“      | 266     | USD     | 22.307    | 0,01                 |
| CONSOL ENERGY                    | 1.901  | USD     | 45.339    | 0,02                 | DOLLAR GENERAL              | 3.873   | USD     | 602.949   | 0,23                 |
| CONSOL ENERGY CORP KONSOLIDIERT  | 106    | USD     | 8.812     | 0,00                 | DOLLAR TREE STORES          | 3.742   | USD     | 498.285   | 0,19                 |
| COMMUNICATIONS                   | 3.116  | USD     | 13.477    | 0,01                 | DOMINION RESOURCES          | 4.405   | USD     | 216.638   | 0,08                 |
| CONSTELLATION BRANDS             | 348    | USD     | 94.204    | 0,04                 | DOMINO'S PIZZA              | 148     | USD     | 73.140    | 0,03                 |
| CONSTELLATION ENERGY             | 1.977  | USD     | 364.381   | 0,14                 | DONALDSON                   | 1.174   | USD     | 87.557    | 0,03                 |
| COOPER COS INC                   | 378    | USD     | 38.496    | 0,01                 | DOORDASH                    | 422     | USD     | 58.882    | 0,02                 |
| COPART                           | 1.412  | USD     | 81.938    | 0,03                 | DOVER                       | 1.023   | USD     | 181.030   | 0,07                 |
| CORNING                          | 11.790 | USD     | 389.306   | 0,15                 | DOW                         | 7.862   | USD     | 455.524   | 0,17                 |
| CORPAY                           | 349    | USD     | 107.080   | 0,04                 | DR HORTON                   | 760     | USD     | 125.476   | 0,05                 |
| CORTEVA                          | 3.747  | USD     | 216.689   | 0,08                 | DROPBOX                     | 1.094   | USD     | 26.442    | 0,01                 |
| COSTCO WHOLESALE                 | 1.492  | USD     | 1.089.130 | 0,41                 | DTE ENERGY                  | 321     | USD     | 35.897    | 0,01                 |
| COTY „A“                         | 9.491  | USD     | 112.184   | 0,04                 | DUKE ENERGY                 | 2.333   | USD     | 224.761   | 0,08                 |
| CRACKER BARREL OLD COUNTRY STORE | 840    | USD     | 61.488    | 0,02                 | DUN & BRADSTREET HOLDINGS   | 3.704   | USD     | 37.577    | 0,01                 |
| CRANE                            | 505    | USD     | 68.392    | 0,03                 | DUPONT DE NEMOURS           | 7.249   | USD     | 557.521   | 0,21                 |
| CREDIT ACCEPTANCE GROUP          | 102    | USD     | 56.413    | 0,02                 | DXC TECHNOLOGY              | 29.679  | USD     | 628.750   | 0,24                 |
| CROSS COUNTRY HEALTHCARE         | 945    | USD     | 17.483    | 0,01                 | DYCOM INDUSTRIES            | 510     | USD     | 73.812    | 0,03                 |
|                                  |        |         |           |                      | EAGLE MATERIALS             | 120     | USD     | 32.614    | 0,01                 |
|                                  |        |         |           |                      | EAST WEST BANCORP           | 540     | USD     | 42.854    | 0,02                 |
|                                  |        |         |           |                      | EASTMAN CHEMICALS           | 1.670   | USD     | 166.800   | 0,06                 |
|                                  |        |         |           |                      | EATON                       | 2.177   | USD     | 683.861   | 0,26                 |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Economic Scale US Equity (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung             | Anzahl | Wäh-<br>rung | Kurswert  | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens | Beschreibung                      | Anzahl  | Wäh-<br>rung | Kurswert  | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |
|--------------------------|--------|--------------|-----------|-----------------------------------|-----------------------------------|---------|--------------|-----------|-----------------------------------|
| EBAY                     | 8.270  | USD          | 436.243   | 0,16                              | FEDEX                             | 5.090   | USD          | 1.469.534 | 0,55                              |
| EBIX                     | 3.684  | USD          | 3.581     | 0,00                              | FIDELITY NATIONAL                 |         |              |           |                                   |
| ECOLAB                   | 1.320  | USD          | 303.917   | 0,11                              | INFORMATION                       | 5.659   | USD          | 421.709   | 0,16                              |
| ECOVYST                  | 3.622  | USD          | 40.711    | 0,02                              | FIFTH THIRD BANCORP               | 6.656   | USD          | 247.037   | 0,09                              |
| EDGEWELL PERSONAL CARE   | 848    | USD          | 33.004    | 0,01                              | FIRST ADVANTAGE                   | 1.968   | USD          | 32.000    | 0,01                              |
| EDWARDS LIFESCIENCES     | 1.423  | USD          | 135.128   | 0,05                              | FIRST AMERICAN FINANCIAL          | 1.846   | USD          | 111.960   | 0,04                              |
| ELANCO ANIMAL HEALTH     | 1.701  | USD          | 27.573    | 0,01                              | FIRST CITIZENS                    |         |              |           |                                   |
| ELECTRONIC ARTS          | 694    | USD          | 92.420    | 0,03                              | BANCSHARES „A“                    | 89      | USD          | 146.509   | 0,06                              |
| ELEMENT SOLUTION         | 3.013  | USD          | 75.174    | 0,03                              | FIRST HORIZON NATIONAL            | 4.930   | USD          | 76.021    | 0,03                              |
| ELI LILLY                | 620    | USD          | 488.287   | 0,18                              | FIRST INTERSTATE                  |         |              |           |                                   |
| EMBECTA CORPORATION      | 8.596  | USD          | 115.100   | 0,04                              | BANCOSYS „A“                      | 1.258   | USD          | 34.633    | 0,01                              |
| EMCOR GROUP              | 673    | USD          | 237.253   | 0,09                              | FIRST SOLAR                       | 106     | USD          | 17.818    | 0,01                              |
| EMERSON ELECTRIC         | 5.020  | USD          | 569.971   | 0,21                              | FIRSTCASH HOLDINGS                | 632     | USD          | 80.719    | 0,03                              |
| ENCOMPASS HEALTH CORP    | 2.118  | USD          | 173.507   | 0,07                              | FIRSTENERGY                       | 2.615   | USD          | 100.847   | 0,04                              |
| ENCORE CAPITAL GROUP     | 289    | USD          | 13.254    | 0,00                              | FISERV                            | 2.635   | USD          | 420.520   | 0,16                              |
| ENERSYS                  | 338    | USD          | 32.184    | 0,01                              | FIVE BELOW                        | 291     | USD          | 53.270    | 0,02                              |
| ENLINK MIDSTREAM         | 2.953  | USD          | 39.570    | 0,01                              | FLOWER FOODS                      | 2.060   | USD          | 48.977    | 0,02                              |
| ENOVIS                   | 1.067  | USD          | 66.442    | 0,03                              | FLOWERVE                          | 2.015   | USD          | 92.609    | 0,03                              |
| ENPRO INDUSTRIES         | 87     | USD          | 14.783    | 0,01                              | FLUOR                             | 4.963   | USD          | 209.836   | 0,08                              |
| ENSIGN GROUP             | 795    | USD          | 100.377   | 0,04                              | FMC                               | 755     | USD          | 47.776    | 0,02                              |
| ENTERGIS                 | 281    | USD          | 39.579    | 0,01                              | FNB                               | 2.767   | USD          | 39.125    | 0,01                              |
| ENTERGY                  | 430    | USD          | 45.288    | 0,02                              | FNFV GROUP                        | 3.824   | USD          | 201.372   | 0,08                              |
| ENVISTA HOLDINGS         | 1.830  | USD          | 39.308    | 0,01                              | FOOT LOCKER                       | 4.804   | USD          | 136.866   | 0,05                              |
| EOG RESOURCES            | 2.734  | USD          | 348.312   | 0,13                              | FORD MOTOR                        | 111.767 | USD          | 1.482.589 | 0,56                              |
| EPAM SYSTEMS             | 625    | USD          | 172.319   | 0,06                              | FORTINET                          | 1.255   | USD          | 85.516    | 0,03                              |
| EQT                      | 1.482  | USD          | 54.552    | 0,02                              | FORTIVE CORP                      | 1.271   | USD          | 109.242   | 0,04                              |
| EQUIFAX                  | 209    | USD          | 55.634    | 0,02                              | FORTREA HOLDINGS                  | 1.455   | USD          | 58.156    | 0,02                              |
| EQUINIX REIT             | 80     | USD          | 65.880    | 0,02                              | FORTUNE BRANDS HOME &<br>SECURITY | 1.415   | USD          | 119.865   | 0,05                              |
| EQUITABLE HOLDINGS       | 4.600  | USD          | 176.134   | 0,07                              | FOX CORPORATIONS                  | 3.111   | USD          | 96.690    | 0,04                              |
| EQUITY COMMONWEALTH      | 1.211  | USD          | 22.888    | 0,01                              | FRANK RESOURCES                   | 7.085   | USD          | 198.451   | 0,07                              |
| EQUITY LIFESTYLE         |        |              |           |                                   | FRANKLIN ELECTRIC                 | 305     | USD          | 32.870    | 0,01                              |
| PROPERTIES REIT          | 350    | USD          | 22.586    | 0,01                              | FREEMPORT MCMORAN COPPER          |         |              |           |                                   |
| EQUITY RESIDENTIAL       | 1.687  | USD          | 106.500   | 0,04                              | „B“                               | 7.306   | USD          | 342.359   | 0,13                              |
| ERIE INDEMNITY „A“       | 128    | USD          | 52.280    | 0,02                              | FRESH DEL MONTE PRODUCE           | 4.876   | USD          | 127.800   | 0,05                              |
| ESSEX PROPERTY REIT      | 274    | USD          | 66.968    | 0,03                              | FRONTIER COMMUNICATIONS           |         |              |           |                                   |
| ESTEE LAUDER „A“         | 2.277  | USD          | 350.590   | 0,13                              | PARENT                            | 5.165   | USD          | 125.974   | 0,05                              |
| EURONET WORLDWIDE        | 339    | USD          | 37.422    | 0,01                              | FRONTIER GROUP HOLDINGS           | 3.171   | USD          | 25.844    | 0,01                              |
| EVERCORE PARTNERS „A“    | 630    | USD          | 121.659   | 0,05                              | FTI CONSULTING                    | 78      | USD          | 16.480    | 0,01                              |
| EVEREST RE GROUP         | 32     | USD          | 12.744    | 0,00                              | GALLAGHER                         | 519     | USD          | 129.714   | 0,05                              |
| EVERGY INC               | 1.572  | USD          | 83.866    | 0,03                              | GAMESTOP                          | 1.556   | USD          | 19.637    | 0,01                              |
| EXELON                   | 5.253  | USD          | 196.462   | 0,07                              | GAMING AND LEISURE                |         |              |           |                                   |
| EXLSERVICE HOLDINGS      | 4.914  | USD          | 156.757   | 0,06                              | PROPERTIES                        | 566     | USD          | 26.070    | 0,01                              |
| EXPEDIA                  | 1.285  | USD          | 178.461   | 0,07                              | GAP                               | 14.385  | USD          | 395.731   | 0,15                              |
| EXPEDITOR INTERNATIONAL  | 1.062  | USD          | 129.723   | 0,05                              | GARRETT MOTION                    | 3.688   | USD          | 36.917    | 0,01                              |
| EXXON MOBIL              | 19.474 | USD          | 2.252.363 | 0,85                              | GARTNER „A“                       | 255     | USD          | 123.096   | 0,05                              |
| EZCORP                   | 2.207  | USD          | 24.851    | 0,01                              | GE HEALTHCARE                     |         |              |           |                                   |
| F5 NETWORKS              | 251    | USD          | 47.790    | 0,02                              | TECHNOLOGIES                      | 6.347   | USD          | 575.546   | 0,22                              |
| FACEBOOK                 | 4.756  | USD          | 2.319.025 | 0,87                              | GENERAC HOLDINGS                  | 144     | USD          | 18.253    | 0,01                              |
| FACTSET RESEARCH SYSTEMS | 150    | USD          | 67.796    | 0,03                              | GENERAL DYNAMICS                  | 2.003   | USD          | 565.727   | 0,21                              |
| FAIR ISSAC               | 17     | USD          | 21.353    | 0,01                              | GENERAL ELECTRIC                  | 11.636  | USD          | 2.037.580 | 0,77                              |
| FASTENAL                 | 1.655  | USD          | 128.263   | 0,05                              | GENERAL MILLS                     | 3.294   | USD          | 231.239   | 0,09                              |
| FEDERATED INVESTORS      | 1.126  | USD          | 40.468    | 0,02                              |                                   |         |              |           |                                   |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Economic Scale US Equity (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung            | Anzahl | Wäh-<br>rung | Kurswert  | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens | Beschreibung            | Anzahl | Wäh-<br>rung | Kurswert  | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |
|-------------------------|--------|--------------|-----------|-----------------------------------|-------------------------|--------|--------------|-----------|-----------------------------------|
| GENERAL MOTORS          | 29.611 | USD          | 1.340.786 | 0,50                              | HERTZ GLOBAL HOLDINGS   | 18.264 | USD          | 144.286   | 0,05                              |
| GENESCO                 | 1.928  | USD          | 53.078    | 0,02                              | HESS                    | 972    | USD          | 147.462   | 0,06                              |
| GENTEX                  | 1.573  | USD          | 57.068    | 0,02                              | HEWLETT PACKARD         |        |              |           |                                   |
| GENTHERM                | 641    | USD          | 37.018    | 0,01                              | ENTERPRISE              | 25.713 | USD          | 458.206   | 0,17                              |
| GENUINE PARTS           | 1.414  | USD          | 219.736   | 0,08                              | HEXCEL                  | 510    | USD          | 37.342    | 0,01                              |
| GENWORTH FINANCIAL „A“  | 2.285  | USD          | 14.818    | 0,01                              | HF SINCLAIR             | 1.444  | USD          | 87.030    | 0,03                              |
| GEO GROUP               | 9.384  | USD          | 133.910   | 0,05                              | HIBBETT SPORTING GOODS  | 343    | USD          | 26.253    | 0,01                              |
| GILEAD SCIENCES         | 5.982  | USD          | 440.275   | 0,17                              | HILLENBRAND             | 1.043  | USD          | 52.536    | 0,02                              |
| GITLAB                  | 447    | USD          | 26.360    | 0,01                              | HNI                     | 1.014  | USD          | 46.107    | 0,02                              |
| GLOBAL PAYMENTS         | 1.333  | USD          | 176.956   | 0,07                              | HOLOGIC                 | 901    | USD          | 69.796    | 0,03                              |
| GLOBE LIFE              | 305    | USD          | 35.444    | 0,01                              | HOME DEPOT              | 5.806  | USD          | 2.223.814 | 0,84                              |
| GODADDY „A“             | 436    | USD          | 52.438    | 0,02                              | HONEYWELL INTERNATIONAL | 3.806  | USD          | 784.493   | 0,30                              |
| GOLDMAN SACHS GROUP     | 2.980  | USD          | 1.242.064 | 0,47                              | HORMEL FOODS            | 2.874  | USD          | 100.188   | 0,04                              |
| GOODYEAR TIRE           | 21.720 | USD          | 300.062   | 0,11                              | HOST MARRIOTT           | 3.333  | USD          | 68.360    | 0,03                              |
| GRACO                   | 366    | USD          | 34.433    | 0,01                              | HP                      | 15.240 | USD          | 459.943   | 0,17                              |
| GRAFTECH INTERNATIONAL  | 6.388  | USD          | 8.464     | 0,00                              | HUBBELL                 | 304    | USD          | 126.418   | 0,05                              |
| GRAHAM HOLDINGS „B“     | 91     | USD          | 69.322    | 0,03                              | HUBSPOT                 | 49     | USD          | 30.509    | 0,01                              |
| GRAINGER W W            | 157    | USD          | 160.531   | 0,06                              | HUMANA                  | 636    | USD          | 221.792   | 0,08                              |
| GRAND CANYON EDUCATION  | 216    | USD          | 29.439    | 0,01                              | HUNTINGTON BANCSHARES   | 14.564 | USD          | 202.367   | 0,08                              |
| GRAPHIC PACKAGING       |        |              |           |                                   | HUNTINGTON INGALLS      |        |              |           |                                   |
| HOLDING                 | 4.111  | USD          | 120.452   | 0,05                              | INDUSTRIES              | 755    | USD          | 220.838   | 0,08                              |
| GRAY TELEVISION         | 2.651  | USD          | 16.569    | 0,01                              | HUNTSMAN                | 2.622  | USD          | 68.539    | 0,03                              |
| GREENBRIER COMPANIES    | 817    | USD          | 42.893    | 0,02                              | HYATT HOTELS            | 473    | USD          | 76.224    | 0,03                              |
| GREIF                   | 1.124  | USD          | 77.702    | 0,03                              | HYSTE-YALE MATERIALS    |        |              |           |                                   |
| GRIFFON                 | 517    | USD          | 37.839    | 0,01                              | HANDLING „A“            | 682    | USD          | 43.321    | 0,02                              |
| GROUP 1 AUTOMOTIVE      | 179    | USD          | 52.590    | 0,02                              | IAC INTERACTIVECORP     | 618    | USD          | 33.032    | 0,01                              |
| GUESS                   | 1.891  | USD          | 58.980    | 0,02                              | ICF INTERNATIONAL       | 206    | USD          | 31.106    | 0,01                              |
| GULFPORT ENERGY         | 291    | USD          | 46.770    | 0,02                              | ICU MEDICAL             | 329    | USD          | 34.955    | 0,01                              |
| GXO LOGISTICS           | 3.244  | USD          | 175.111   | 0,07                              | IDEX                    | 231    | USD          | 56.551    | 0,02                              |
| H B FULLER              | 538    | USD          | 43.680    | 0,02                              | IDEXX LABORATORIES      | 125    | USD          | 67.858    | 0,03                              |
| H&R BLOCK               | 979    | USD          | 48.118    | 0,02                              | IES HOLDINGS            | 297    | USD          | 36.276    | 0,01                              |
| HAIN CELESTIAL GROUP    | 2.384  | USD          | 18.941    | 0,01                              | ILLINOIS TOOL WORKS     | 1.389  | USD          | 372.571   | 0,14                              |
| HALFMOON PARENT         | 2.742  | USD          | 1.000.117 | 0,38                              | ILLUMINA                | 250    | USD          | 34.440    | 0,01                              |
| HALLIBURTON             | 9.036  | USD          | 356.289   | 0,13                              | INCYTE GENOMICS         | 465    | USD          | 26.421    | 0,01                              |
| HANCOCK HOLDING         | 685    | USD          | 31.661    | 0,01                              | INFORMATICA             | 1.472  | USD          | 51.586    | 0,02                              |
| HANESBRANDS             | 63.497 | USD          | 366.378   | 0,14                              | INGERSOLL RAND          | 1.485  | USD          | 141.624   | 0,05                              |
| HANOVER INSURANCE       |        |              |           |                                   | INGLES MARKETS „A“      | 822    | USD          | 62.702    | 0,02                              |
| GROUP                   | 309    | USD          | 42.240    | 0,02                              | INGREDION               | 561    | USD          | 66.058    | 0,02                              |
| HARLEY-DAVIDSON         | 1.364  | USD          | 59.811    | 0,02                              | INSIGHT ENTERPRISES     | 186    | USD          | 34.661    | 0,01                              |
| HARSCO                  | 4.961  | USD          | 44.971    | 0,02                              | INSPERITY               | 1.742  | USD          | 192.334   | 0,07                              |
| HARTF FINANCIAL         |        |              |           |                                   | INSTALLED BUILDING      |        |              |           |                                   |
| SERVICES GROUP          | 2.003  | USD          | 206.029   | 0,08                              | PRODUCTS                | 234    | USD          | 61.156    | 0,02                              |
| HASBRO                  | 1.369  | USD          | 77.129    | 0,03                              | INTEGER HOLDINGS        | 412    | USD          | 48.369    | 0,02                              |
| HCA HOLDINGS            | 5.459  | USD          | 1.811.187 | 0,68                              | INTEGRA LIFESCIENCES    | 578    | USD          | 20.051    | 0,01                              |
| HEALTHCARE REALTY TRUST | 1.836  | USD          | 26.071    | 0,01                              | INTEL                   | 34.773 | USD          | 1.547.399 | 0,58                              |
| HEALTHPEAK              | 2.572  | USD          | 48.084    | 0,02                              | INTERCONTINENTAL        |        |              |           |                                   |
| HEICO                   | 188    | USD          | 36.275    | 0,01                              | EXCHANGE GROUP          | 1.479  | USD          | 203.377   | 0,08                              |
| HEIDRICK & STRUGGLES    |        |              |           |                                   | INTERNATION FLAVOURS &  |        |              |           |                                   |
| INTERNATIONAL           | 624    | USD          | 21.004    | 0,01                              | FRAGRANCES              | 1.577  | USD          | 134.849   | 0,05                              |
| HELMERICH & PAYNE       | 1.342  | USD          | 57.008    | 0,02                              | INTERNATIONAL BUSINESS  |        |              |           |                                   |
| HERC HOLDINGS           | 194    | USD          | 32.999    | 0,01                              | MACHINES                | 10.382 | USD          | 1.982.651 | 0,75                              |
| HERMAN MILLER           | 667    | USD          | 16.722    | 0,01                              | INTERNATIONAL PAPER     | 9.231  | USD          | 360.286   | 0,14                              |
| HERSHEY COMPANY         | 685    | USD          | 134.678   | 0,05                              | INTERPUBLIC GROUP       | 9.247  | USD          | 304.134   | 0,11                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Economic Scale US Equity (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung                 | Anzahl | Wäh-<br>rung | Kurswert  | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens | Beschreibung               | Anzahl  | Wäh-<br>rung | Kurswert  | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |
|------------------------------|--------|--------------|-----------|-----------------------------------|----------------------------|---------|--------------|-----------|-----------------------------------|
| INTUIT                       | 160    | USD          | 104.550   | 0,04                              | KRAFT HEINZ                | 11.359  | USD          | 419.658   | 0,16                              |
| INTUITIVE SURGICAL           | 226    | USD          | 90.497    | 0,03                              | KROGER                     | 29.333  | USD          | 1.676.381 | 0,63                              |
| INVESCO                      | 7.959  | USD          | 133.074   | 0,05                              | KYNDRYL HOLDINGS           | 9.801   | USD          | 212.780   | 0,08                              |
| INVITATION HOMES REIT        | 1.290  | USD          | 45.589    | 0,02                              | L BRANDS                   | 6.627   | USD          | 329.826   | 0,12                              |
| IPG PHOTONICS                | 400    | USD          | 36.604    | 0,01                              | LABORATORY AMER            | 1.256   | USD          | 272.803   | 0,10                              |
| IQVIA HOLDINGS               | 1.641  | USD          | 413.368   | 0,16                              | LAM RESEARCH               | 302     | USD          | 293.879   | 0,11                              |
| IRON MOUNTAIN                |        |              |           |                                   | LAMAR ADVERTISING „A“      | 372     | USD          | 44.614    | 0,02                              |
| INCORPORATED REIT            | 1.089  | USD          | 87.566    | 0,03                              | LANDSTAR SYSTEM            | 128     | USD          | 24.494    | 0,01                              |
| ITRON                        | 238    | USD          | 22.129    | 0,01                              | LAS VEGAS SANDS            | 2.619   | USD          | 135.455   | 0,05                              |
| ITT                          | 497    | USD          | 68.104    | 0,03                              | LAUREATE EDUCATION         | 12.806  | USD          | 186.904   | 0,07                              |
| J.B. HUNT TRANSPORT SERVICES | 872    | USD          | 174.095   | 0,07                              | LA-Z-BOY CHAIR             | 1.350   | USD          | 50.693    | 0,02                              |
| J2 GLOBAL                    | 476    | USD          | 30.359    | 0,01                              | LCI INDUSTRIES             | 405     | USD          | 49.532    | 0,02                              |
| JABIL CIRCUIT                | 7.556  | USD          | 1.020.362 | 0,38                              | LEAR                       | 5.180   | USD          | 755.710   | 0,28                              |
| JACK HENRY & ASSOCIATES      | 286    | USD          | 49.518    | 0,02                              | LEGGETT & PLATT            | 3.144   | USD          | 60.176    | 0,02                              |
| JACKSON FINANCIAL            | 1.021  | USD          | 68.438    | 0,03                              | LEIDOS HOLDINGS            | 1.652   | USD          | 216.164   | 0,08                              |
| JACOBS SOLUTIONS             | 1.914  | USD          | 294.909   | 0,11                              | LENNAR                     | 1.310   | USD          | 225.870   | 0,09                              |
| JEFFERIES FINANCIAL GROUP    | 4.474  | USD          | 199.540   | 0,08                              | LENNOX INTERNATIONAL       | 158     | USD          | 77.137    | 0,03                              |
| JELD WEN HOLDING             | 5.257  | USD          | 111.343   | 0,04                              | LEVI STRAUSS „A“           | 4.958   | USD          | 97.673    | 0,04                              |
| JETBLUE AIRWAYS              | 16.455 | USD          | 123.577   | 0,05                              | LIBERTY BROADBAND „C“      | 1.188   | USD          | 67.241    | 0,03                              |
| JM SMUCKER                   | 764    | USD          | 96.203    | 0,04                              | LIBERTY GLOBAL             | 22.988  | USD          | 406.658   | 0,15                              |
| JOHN BEAN TECHNOLOGIES       | 261    | USD          | 27.502    | 0,01                              | LIBERTY LATIN AMERICA      | 10.154  | USD          | 71.027    | 0,03                              |
| JOHN WILEY & SONS            | 1.561  | USD          | 60.067    | 0,02                              | LIBERTY MEDIA CORP         |         |              |           |                                   |
| JOHNSON & JOHNSON            | 9.256  | USD          | 1.467.261 | 0,55                              | LIBERTY FORMULA            | 785     | USD          | 52.257    | 0,02                              |
| JONES LANG LASALLE           | 1.884  | USD          | 368.171   | 0,14                              | LIBERTY OILFIELD SERVICES  | 711     | USD          | 14.611    | 0,01                              |
| JP MORGAN CHASE              | 19.581 | USD          | 3.908.562 | 1,48                              | LIFE TIME GROUP HOLDINGS   | 4.300   | USD          | 67.209    | 0,03                              |
| JUNIPER NETWORKS             | 2.093  | USD          | 77.912    | 0,03                              | LINCOLN NATIONAL           | 3.548   | USD          | 114.068   | 0,04                              |
| KAR AUCTION SERVICES         | 3.536  | USD          | 61.155    | 0,02                              | LITHIA MOTORS              | 58      | USD          | 17.677    | 0,01                              |
| KB HOME                      | 419    | USD          | 29.896    | 0,01                              | LITTLEFUSE                 | 260     | USD          | 63.011    | 0,02                              |
| KBR                          | 1.953  | USD          | 125.285   | 0,05                              | LKQ                        | 3.870   | USD          | 207.432   | 0,08                              |
| KELLOGG                      | 3.758  | USD          | 215.146   | 0,08                              | LOEWS                      | 1.757   | USD          | 137.608   | 0,05                              |
| KELLY SERVICES „A“           | 1.441  | USD          | 36.212    | 0,01                              | LOUISIANA PACIFIC          | 719     | USD          | 60.209    | 0,02                              |
| KEMPER                       | 1.029  | USD          | 64.210    | 0,02                              | LOWES                      | 5.869   | USD          | 1.487.557 | 0,56                              |
| KENNAMETAL                   | 1.968  | USD          | 48.767    | 0,02                              | LPL FINANCIAL HOLDINGS     | 229     | USD          | 60.438    | 0,02                              |
| KENVUE                       | 8.083  | USD          | 172.774   | 0,07                              | LULULEMON ATHLETICA        | 176     | USD          | 69.235    | 0,03                              |
| KEURIG DR PEPPER             | 5.878  | USD          | 180.690   | 0,07                              | LUMEN TECHNOLOGIES         | 408.306 | USD          | 643.082   | 0,24                              |
| KEYCORP                      | 12.941 | USD          | 203.562   | 0,08                              | LYONDELL BASELL INDUSTRIES | 3.560   | USD          | 365.363   | 0,14                              |
| KEYSIGHT TECHNOLOGIES        | 623    | USD          | 98.222    | 0,04                              | M&T BANK                   | 1.808   | USD          | 263.462   | 0,10                              |
| KIMBALL ELECTRONICS          | 464    | USD          | 9.962     | 0,00                              | MACERICH                   | 1.135   | USD          | 19.465    | 0,01                              |
| KIMBERLY-CLARK               | 2.550  | USD          | 329.256   | 0,12                              | MACY'S                     | 19.397  | USD          | 383.673   | 0,14                              |
| KIMCO REALTY                 | 2.531  | USD          | 49.519    | 0,02                              | MANHATTAN ASSOCIATES       | 142     | USD          | 35.570    | 0,01                              |
| KINDER MORGAN                | 17.242 | USD          | 314.580   | 0,12                              | MANPOWER GROUP             | 1.812   | USD          | 139.162   | 0,05                              |
| KITE REALTY GROUP REIT       | 1.674  | USD          | 36.393    | 0,01                              | MARATHON OIL               | 6.463   | USD          | 182.580   | 0,07                              |
| KKR & CO                     | 1.831  | USD          | 185.389   | 0,07                              | MARATHON PETROLEUM         | 4.010   | USD          | 799.113   | 0,30                              |
| KLA TENCOR                   | 211    | USD          | 147.183   | 0,06                              | MARKEL                     | 69      | USD          | 104.613   | 0,04                              |
| KNIGHT SWIFT                 |        |              |           |                                   | MARRIOTT INTERNATIONAL     | 1.370   | USD          | 347.788   | 0,13                              |
| TRANSPORTATION HOLDINGS      | 2.084  | USD          | 114.412   | 0,04                              | MARRIOTT VACATIONS         |         |              |           |                                   |
| KNOWLES                      | 1.079  | USD          | 17.242    | 0,01                              | WORLDWIDE                  | 1.047   | USD          | 112.270   | 0,04                              |
| KOHL'S                       | 15.181 | USD          | 441.160   | 0,17                              | MARSH & MCLENNAN           | 2.219   | USD          | 458.046   | 0,17                              |
| KONTOOR BRANDS               | 891    | USD          | 53.807    | 0,02                              | MARTIN MARIETTA            |         |              |           |                                   |
| KORN-FERRY INTERNATIONAL     | 1.335  | USD          | 88.203    | 0,03                              | MATERIALS                  | 136     | USD          | 83.403    | 0,03                              |
|                              |        |              |           |                                   | MARVELL TECHNOLOGY         | 647     | USD          | 46.390    | 0,02                              |
|                              |        |              |           |                                   | MASCO                      | 2.252   | USD          | 176.872   | 0,07                              |
|                              |        |              |           |                                   | MASTEC                     | 1.520   | USD          | 142.302   | 0,05                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Economic Scale US Equity (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung                 | Anzahl | Währung | Kurswert  | % des Nettovermögens | Beschreibung                   | Anzahl | Währung | Kurswert | % des Nettovermögens |
|------------------------------|--------|---------|-----------|----------------------|--------------------------------|--------|---------|----------|----------------------|
| MASTERBRAND                  | 2.438  | USD     | 46.395    | 0,02                 | NABORS INDUSTRIES              | 1.069  | USD     | 93.773   | 0,04                 |
| MASTERCARD                   | 1.443  | USD     | 692.698   | 0,26                 | NASDAQ OMX GROUP               | 1.646  | USD     | 103.830  | 0,04                 |
| MATCH GROUP                  | 839    | USD     | 30.607    | 0,01                 | NATIONAL FUEL GAS              | 413    | USD     | 22.108   | 0,01                 |
| MATSON                       | 231    | USD     | 26.195    | 0,01                 | NATIONAL OILWELL VARCO         | 6.565  | USD     | 129.593  | 0,05                 |
| MATTEL                       | 7.278  | USD     | 143.886   | 0,05                 | NATIONAL VISION HOLDINGS       | 2.001  | USD     | 44.762   | 0,02                 |
| MATTHEWS INTERNATIONAL       | 604    | USD     | 18.778    | 0,01                 | NAVIENT                        | 3.007  | USD     | 52.382   | 0,02                 |
| MAXIMUS                      | 1.479  | USD     | 125.049   | 0,05                 | NCR                            | 5.596  | USD     | 70.566   | 0,03                 |
| MCCORMICK                    | 1.347  | USD     | 103.719   | 0,04                 | NCR ATLEOS                     | 2.176  | USD     | 43.716   | 0,02                 |
| MCDONALDS                    | 1.730  | USD     | 489.365   | 0,18                 | NELNET                         | 362    | USD     | 34.285   | 0,01                 |
| MCKESSON HBOC                | 740    | USD     | 398.009   | 0,15                 | NETAPP                         | 1.412  | USD     | 149.037  | 0,06                 |
| MDU RESOURCES GROUP          | 1.605  | USD     | 40.077    | 0,02                 | NETFLIX                        | 1.076  | USD     | 653.003  | 0,25                 |
| MEDNAX                       | 9.970  | USD     | 100.996   | 0,04                 | NEW RESIDENTIAL INVESTMENT     | 3.005  | USD     | 33.551   | 0,01                 |
| MEDPACE HOLDINGS             | 57     | USD     | 22.994    | 0,01                 | NEW YORK COMMUNITY BANCORP     | 5.982  | USD     | 19.382   | 0,01                 |
| MERCK & CO                   | 7.823  | USD     | 1.030.993 | 0,39                 | NEW YORK TIMES „A“             | 724    | USD     | 31.443   | 0,01                 |
| MERCURY GENERAL              | 396    | USD     | 20.556    | 0,01                 | NEWELL RUBBERMAID              | 23.373 | USD     | 184.764  | 0,07                 |
| MERIT MEDICAL SYSTEMS        | 383    | USD     | 29.181    | 0,01                 | NEWMARK GROUP                  | 8.426  | USD     | 95.972   | 0,04                 |
| METHODE ELECTRONICS          | 1.274  | USD     | 15.313    | 0,01                 | NEWMONT MINING                 | 6.968  | USD     | 250.569  | 0,09                 |
| METLIFE                      | 6.460  | USD     | 478.880   | 0,18                 | NEWS „A“                       | 7.646  | USD     | 202.122  | 0,08                 |
| METTLER TOLEDO INTERNATIONAL | 90     | USD     | 120.813   | 0,05                 | NEXSTAR BROADCASTING GROUP „A“ | 786    | USD     | 136.182  | 0,05                 |
| MGIC INVESTMENT              | 1.537  | USD     | 34.383    | 0,01                 | NEXTERA ENERGY                 | 1.482  | USD     | 94.485   | 0,04                 |
| MGM RESORTS INTERNATIONAL    | 4.380  | USD     | 207.130   | 0,08                 | NEXTERA ENERGY                 |        |         |          |                      |
| MICROCHIP TECHNOLOGY         | 1.555  | USD     | 139.484   | 0,05                 | PARTNERS                       | 721    | USD     | 21.212   | 0,01                 |
| MICRON TECHNOLOGY            | 7.216  | USD     | 853.689   | 0,32                 | NEXTRACKER                     | 4.904  | USD     | 282.372  | 0,11                 |
| MICROSOFT                    | 9.382  | USD     | 3.949.352 | 1,50                 | NIKE „B“                       | 4.076  | USD     | 382.247  | 0,14                 |
| MIDDLEBY                     | 278    | USD     | 44.405    | 0,02                 | NISOURCE                       | 959    | USD     | 26.387   | 0,01                 |
| MINERALS TECHNOLOGIES        | 448    | USD     | 34.290    | 0,01                 | NORDSON                        | 221    | USD     | 60.567   | 0,02                 |
| MODERNA                      | 748    | USD     | 80.447    | 0,03                 | NORDSTROM                      | 12.458 | USD     | 251.776  | 0,09                 |
| MODINE MANUFACTURING         | 924    | USD     | 88.649    | 0,03                 | NORFOLK SOUTHERN               | 1.460  | USD     | 370.986  | 0,14                 |
| MODIVCARE                    | 499    | USD     | 11.976    | 0,00                 | NORTHERN TRUST                 | 2.115  | USD     | 187.854  | 0,07                 |
| MOELIS & COMPANY             | 879    | USD     | 50.771    | 0,02                 | NORTONLIFELOCK                 | 9.239  | USD     | 206.399  | 0,08                 |
| MOHAWK INDUSTRIES            | 2.171  | USD     | 282.708   | 0,11                 | NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS | 1.500  | USD     | 31.725   | 0,01                 |
| MOLINA HEALTHCARE            | 217    | USD     | 89.734    | 0,03                 | NRG ENERGY                     | 1.617  | USD     | 109.180  | 0,04                 |
| MOLSON COORS BREWING „B“     | 2.413  | USD     | 161.599   | 0,06                 | NU SKIN ENTERPRISES „A“        | 347    | USD     | 4.768    | 0,00                 |
| MONDELEZ INTERNATIONAL „A“   | 7.054  | USD     | 494.838   | 0,19                 | NUCOR                          | 1.530  | USD     | 302.787  | 0,11                 |
| MONRO MUFFLER BRAKE          | 836    | USD     | 26.643    | 0,01                 | NVIDIA                         | 340    | USD     | 308.703  | 0,12                 |
| MONSTER BEVERAGE             | 744    | USD     | 44.231    | 0,02                 | NVR                            | 11     | USD     | 89.442   | 0,03                 |
| MOODYS                       | 324    | USD     | 128.032   | 0,05                 | O I GLASS                      | 8.121  | USD     | 134.890  | 0,05                 |
| MOOG                         | 455    | USD     | 72.527    | 0,03                 | OCCIDENTAL PETROLEUM           | 9.789  | USD     | 634.376  | 0,24                 |
| MORGAN STANLEY               | 18.986 | USD     | 1.782.026 | 0,67                 | OCEANEERING INTERNATIONAL      | 1.898  | USD     | 44.546   | 0,02                 |
| MORNINGSTAR                  | 118    | USD     | 36.368    | 0,01                 | OGE ENERGY                     | 728    | USD     | 24.978   | 0,01                 |
| MOTOROLA SOLUTIONS           | 390    | USD     | 137.768   | 0,05                 | OLD DOMINION FREIGHT LINE      | 842    | USD     | 184.246  | 0,07                 |
| MR COOPER GROUP              | 800    | USD     | 62.720    | 0,02                 | OLD NATIONAL BANCORP           | 1.825  | USD     | 31.919   | 0,01                 |
| MSA SAFETY                   | 99     | USD     | 19.174    | 0,01                 | OLD REPUBLIC INTERNATIONAL     | 2.758  | USD     | 85.139   | 0,03                 |
| MSC INDUSTRIAL DIRECT „A“    | 342    | USD     | 33.837    | 0,01                 | OLIN                           | 1.880  | USD     | 110.713  | 0,04                 |
| MSCI                         | 114    | USD     | 63.894    | 0,02                 | OLLIES BARGAIN OUTLET HOLDINGS | 403    | USD     | 32.010   | 0,01                 |
| MUELLER INDUSTRIES           | 513    | USD     | 27.989    | 0,01                 | OMNICOM                        | 6.657  | USD     | 647.194  | 0,24                 |
| MULTIPLAN                    | 30.174 | USD     | 25.093    | 0,01                 | ON SEMICONDUCTOR               | 1.954  | USD     | 145.710  | 0,05                 |
| MURPHY OIL                   | 1.353  | USD     | 61.940    | 0,02                 |                                |        |         |          |                      |
| MURPHY USA                   | 119    | USD     | 50.175    | 0,02                 |                                |        |         |          |                      |
| MYR GROUP                    | 226    | USD     | 40.461    | 0,02                 |                                |        |         |          |                      |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Economic Scale US Equity (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung                        | Anzahl | Wäh-<br>rung | Kurswert  | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens | Beschreibung                    | Anzahl  | Wäh-<br>rung | Kurswert  | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |
|-------------------------------------|--------|--------------|-----------|-----------------------------------|---------------------------------|---------|--------------|-----------|-----------------------------------|
| ONE GAS                             | 391    | USD          | 25.231    | 0,01                              | POOL                            | 72      | USD          | 29.344    | 0,01                              |
| ONEMAIN HOLDINGS                    | 1.740  | USD          | 88.757    | 0,03                              | POPULAR                         | 752     | USD          | 66.326    | 0,02                              |
| ONEOK                               | 898    | USD          | 71.867    | 0,03                              | POST HOLDINGS                   | 281     | USD          | 30.050    | 0,01                              |
| OPENDOOR TECHNOLOGIES               | 4.207  | USD          | 13.231    | 0,00                              | POTLATCH                        | 527     | USD          | 24.743    | 0,01                              |
| ORACLE (US68389X1054)               | 14.899 | USD          | 1.869.973 | 0,70                              | PPG INDUSTRIES                  | 1.825   | USD          | 264.443   | 0,10                              |
| O'REILLY AUTOMOTIVE                 | 332    | USD          | 377.720   | 0,14                              | PPL                             | 5.264   | USD          | 144.128   | 0,05                              |
| ORGANON & CO                        | 5.584  | USD          | 104.868   | 0,04                              | PRICESMART                      | 149     | USD          | 12.540    | 0,00                              |
| OSHKOSH TRUCK                       | 812    | USD          | 101.256   | 0,04                              | PRIMERICA                       | 138     | USD          | 35.307    | 0,01                              |
| OSI SYSTEMS                         | 253    | USD          | 36.009    | 0,01                              | PRINCIPAL FINANCIAL GROUP       | 2.180   | USD          | 188.069   | 0,07                              |
| OTIS WORLDWIDE                      | 5.152  | USD          | 513.191   | 0,19                              | PROCTER AND GAMBLE              | 7.961   | USD          | 1.291.593 | 0,49                              |
| OVINTIV                             | 3.503  | USD          | 182.016   | 0,07                              | PROG HOLDINGS                   | 818     | USD          | 28.426    | 0,01                              |
| OWENS CORNING                       | 830    | USD          | 139.282   | 0,05                              | PROGRESSIVE                     | 1.923   | USD          | 398.042   | 0,15                              |
| PACCAR                              | 2.221  | USD          | 275.293   | 0,10                              | PROLOGIS                        | 902     | USD          | 116.593   | 0,04                              |
| PACKAGING CORPORATION<br>OF AMERICA | 693    | USD          | 131.601   | 0,05                              | PROSPERITY BANCSHARES           | 434     | USD          | 28.553    | 0,01                              |
| PACTIV EVERGREEN                    | 8.475  | USD          | 121.193   | 0,05                              | PRUDENTIAL FINANCIAL            | 3.373   | USD          | 395.855   | 0,15                              |
| PALO ALTO NETWORKS                  | 174    | USD          | 49.381    | 0,02                              | PTC                             | 205     | USD          | 38.790    | 0,01                              |
| PARKER-HANNIFIN                     | 574    | USD          | 319.144   | 0,12                              | PUBLIC SERVICE                  |         |              |           |                                   |
| PARSONS                             | 947    | USD          | 78.904    | 0,03                              | ENTERPRISE GROUP                | 1.605   | USD          | 106.973   | 0,04                              |
| PATRICK INDUSTRIES                  | 411    | USD          | 49.550    | 0,02                              | PUBLIC STORAGE                  | 355     | USD          | 102.765   | 0,04                              |
| PATTERSON                           | 1.130  | USD          | 31.538    | 0,01                              | PULTE GROUP                     | 921     | USD          | 111.128   | 0,04                              |
| PATTERSON-UTI ENERGY                | 8.928  | USD          | 108.431   | 0,04                              | PVH                             | 1.585   | USD          | 221.884   | 0,08                              |
| PAYCHEX                             | 1.057  | USD          | 129.472   | 0,05                              | QORVO                           | 781     | USD          | 89.760    | 0,03                              |
| PAYCOM SOFTWARE                     | 133    | USD          | 26.616    | 0,01                              | QUALCOMM                        | 5.932   | USD          | 1.002.211 | 0,38                              |
| PAYPAL HOLDINGS                     | 4.049  | USD          | 271.121   | 0,10                              | QUANTA SERVICES                 | 726     | USD          | 189.087   | 0,07                              |
| PBF ENERGY                          | 1.112  | USD          | 63.473    | 0,02                              | QUEST DIAGNOSTICS               | 1.509   | USD          | 199.746   | 0,08                              |
| PEABODY ENERGY                      | 2.230  | USD          | 54.256    | 0,02                              | QURATE RETAIL GROUP             | 192.928 | USD          | 236.337   | 0,09                              |
| PEGASYSTEMS                         | 310    | USD          | 20.166    | 0,01                              | R1 RCM                          | 4.044   | USD          | 53.401    | 0,02                              |
| PENN NATIONAL GAMING                | 361    | USD          | 6.679     | 0,00                              | RACKSPACE TECHNOLOGY            | 10.542  | USD          | 16.762    | 0,01                              |
| PENNYMAC FINANCIAL<br>SERVICES      | 743    | USD          | 69.114    | 0,03                              | RADIAN GROUP                    | 1.153   | USD          | 38.833    | 0,01                              |
| PENSKE AUTO GROUP                   | 782    | USD          | 127.224   | 0,05                              | RADNET                          | 958     | USD          | 46.750    | 0,02                              |
| PEPSICO                             | 9.202  | USD          | 1.614.307 | 0,61                              | RALPH LAUREN                    | 670     | USD          | 125.200   | 0,05                              |
| PERFORMANCE FOOD<br>GROUP           | 674    | USD          | 50.874    | 0,02                              | RANGE RESOURCES                 | 1.288   | USD          | 44.513    | 0,02                              |
| PERKINELMER                         | 584    | USD          | 61.630    | 0,02                              | RAYMOND JAMES FINANCIAL         | 2.841   | USD          | 363.847   | 0,14                              |
| PETCO HEALTH & WELLNESS             | 25.934 | USD          | 57.444    | 0,02                              | RAYTHEON TECHNOLOGY             | 14.588  | USD          | 1.426.123 | 0,54                              |
| PFIZER                              | 41.061 | USD          | 1.144.781 | 0,43                              | REALOGY HOLDINGS                | 8.155   | USD          | 49.134    | 0,02                              |
| PHILIP MORRIS<br>INTERNATIONAL      | 7.860  | USD          | 721.784   | 0,27                              | REALTY INCOME                   | 618     | USD          | 33.344    | 0,01                              |
| PHILLIPS 66                         | 2.553  | USD          | 413.203   | 0,16                              | RED ROCK RESORTS                | 519     | USD          | 31.187    | 0,01                              |
| PHINIA                              | 1.108  | USD          | 42.780    | 0,02                              | REGAL BELOIT                    | 1.047   | USD          | 189.172   | 0,07                              |
| PILGRIMS PRIDE                      | 9.299  | USD          | 321.606   | 0,12                              | REGENCY CENTERS                 | 509     | USD          | 30.805    | 0,01                              |
| PINNACLE FINANCIAL<br>PARTNERS      | 291    | USD          | 25.064    | 0,01                              | REGENERON PHARMS                | 130     | USD          | 125.649   | 0,05                              |
| PINNACLE WEST CAPITAL               | 400    | USD          | 29.628    | 0,01                              | REGIONS FINANCIAL               | 8.820   | USD          | 184.603   | 0,07                              |
| PIONEER NATURAL<br>RESSOURCEN       | 1.189  | USD          | 310.816   | 0,12                              | REINSURANCE GROUP OF<br>AMERICA | 207     | USD          | 40.081    | 0,02                              |
| PIPER JAFFRAY                       | 285    | USD          | 56.954    | 0,02                              | RELIANCE STEEL &<br>ALUMINUM    | 331     | USD          | 111.448   | 0,04                              |
| PITNEY-BOWES                        | 17.496 | USD          | 77.507    | 0,03                              | RENT A CENTER                   | 1.050   | USD          | 37.317    | 0,01                              |
| PJT PARTNERS „A“                    | 332    | USD          | 31.503    | 0,01                              | REPUBLIC SERVICES               | 1.096   | USD          | 210.180   | 0,08                              |
| PLEXUS                              | 859    | USD          | 81.261    | 0,03                              | RESIDEO TECHNOLOGIES            | 3.278   | USD          | 74.575    | 0,03                              |
| PNC FINANCIAL SERVICES              | 3.748  | USD          | 604.777   | 0,23                              | RESMED                          | 352     | USD          | 69.612    | 0,03                              |
| POLARIS INDUSTRIES                  | 468    | USD          | 47.095    | 0,02                              | REV GROUP                       | 1.944   | USD          | 41.796    | 0,02                              |
|                                     |        |              |           |                                   | REYNOLDS CONSUMER<br>PRODUCTS   | 938     | USD          | 26.874    | 0,01                              |
|                                     |        |              |           |                                   | RLJ LODGING TRUST               | 2.299   | USD          | 27.220    | 0,01                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Economic Scale US Equity (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung                        | Anzahl | Wäh-<br>rung | Kurswert | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens | Beschreibung                    | Anzahl | Wäh-<br>rung | Kurswert  | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |
|-------------------------------------|--------|--------------|----------|-----------------------------------|---------------------------------|--------|--------------|-----------|-----------------------------------|
| ROBERT HALF INTERNATIONAL           | 1.104  | USD          | 86.874   | 0,03                              | SNAP-ON                         | 293    | USD          | 87.118    | 0,03                              |
| ROCKET                              | 13.054 | USD          | 192.024  | 0,07                              | SOHO HOUSE & CO                 | 1.602  | USD          | 9.356     | 0,00                              |
| ROCKWELL AUTOMATION                 | 503    | USD          | 146.031  | 0,05                              | SOLARWINDS                      | 2.798  | USD          | 35.283    | 0,01                              |
| ROLLINS                             | 1.540  | USD          | 71.287   | 0,03                              | SONIC AUTOMOTIVE                | 658    | USD          | 37.684    | 0,01                              |
| ROPER INDUSTRIES                    | 214    | USD          | 119.908  | 0,05                              | SONOCO PRODUCTS                 | 1.707  | USD          | 99.125    | 0,04                              |
| ROSS STORES                         | 2.343  | USD          | 345.569  | 0,13                              | SOUTH STATE                     | 551    | USD          | 46.802    | 0,02                              |
| RPM INTERNATIONAL                   | 748    | USD          | 89.573   | 0,03                              | SOUTHERN COMFORT                | 4.240  | USD          | 302.312   | 0,11                              |
| RUSH ENTERTAINMENT „A“              | 591    | USD          | 31.725   | 0,01                              | SOUTHWESTERN ENERGY             | 9.387  | USD          | 71.200    | 0,03                              |
| RXO                                 | 4.220  | USD          | 92.038   | 0,03                              | SP PLUS                         | 723    | USD          | 37.596    | 0,01                              |
| RYAN SPECIALTY GROUP HOLDINGS       | 677    | USD          | 37.851   | 0,01                              | SPARTANNASH                     | 1.874  | USD          | 37.967    | 0,01                              |
| RYDER SYSTEM                        | 2.675  | USD          | 321.455  | 0,12                              | SPECTRUM BRANDS                 | 1.149  | USD          | 102.858   | 0,04                              |
| RYERSON HOLDING                     | 981    | USD          | 33.030   | 0,01                              | SPIRIT AEROSYSTEMS HOLDINGS „A“ | 2.347  | USD          | 84.515    | 0,03                              |
| S&P GLOBAL                          | 1.083  | USD          | 461.455  | 0,17                              | SPIRIT AIRLINE                  | 2.281  | USD          | 11.120    | 0,00                              |
| SABRE                               | 6.618  | USD          | 15.817   | 0,01                              | SPROUTS FARMERS MARKETS         | 1.808  | USD          | 117.267   | 0,04                              |
| SAIA                                | 142    | USD          | 82.633   | 0,03                              | SS&C TECHNOLOGIES               | 2.836  | USD          | 183.943   | 0,07                              |
| SALESFORCE                          | 1.400  | USD          | 421.694  | 0,16                              | HOLDINGS                        |        |              |           |                                   |
| SALLY BEAUTY                        | 7.812  | USD          | 97.259   | 0,04                              | ST MARY LAND & EXPLORATION      | 913    | USD          | 45.148    | 0,02                              |
| SANMINA                             | 3.079  | USD          | 192.037  | 0,07                              | STAGWELL                        | 4.144  | USD          | 25.734    | 0,01                              |
| SCHEIN HENRY                        | 1.015  | USD          | 77.201   | 0,03                              | STANLEY BLACK & DECKER          | 2.960  | USD          | 287.771   | 0,11                              |
| SCHLUMBERGER                        | 13.506 | USD          | 742.155  | 0,28                              | STARBUCKS                       | 6.623  | USD          | 605.872   | 0,23                              |
| SCHNEIDER NATIONAL                  | 3.369  | USD          | 76.678   | 0,03                              | STATE STREET                    | 4.037  | USD          | 311.818   | 0,12                              |
| SCHOLASTIC                          | 866    | USD          | 33.081   | 0,01                              | STEEL DYNAMICS                  | 687    | USD          | 101.834   | 0,04                              |
| SCHWEITZER MAUDUIT INTERNATIONAL    | 543    | USD          | 10.295   | 0,00                              | STEELCASE                       | 4.304  | USD          | 55.995    | 0,02                              |
| SCIENCE APPLICATIONS INTERNATIONAL  | 809    | USD          | 105.939  | 0,04                              | STERICYCLE                      | 1.354  | USD          | 71.979    | 0,03                              |
| SCIENTIFIC GAMES                    | 1.269  | USD          | 130.187  | 0,05                              | STERLING CHECK                  | 2.890  | USD          | 46.963    | 0,02                              |
| SCOTTS MIRACLE-GRO                  | 252    | USD          | 18.814   | 0,01                              | STEVEN MADDEN                   | 631    | USD          | 26.710    | 0,01                              |
| SEALED AIR                          | 2.723  | USD          | 100.914  | 0,04                              | STEWART INFORMATION SERVICES    | 615    | USD          | 39.840    | 0,01                              |
| SEAWORLD ENTERTAINMENT              | 547    | USD          | 31.048   | 0,01                              | STIFEL FINANCIAL                | 1.827  | USD          | 142.396   | 0,05                              |
| SEI INVESTMENTS                     | 870    | USD          | 62.962   | 0,02                              | STONEX GROUP                    | 144    | USD          | 10.014    | 0,00                              |
| SELECT ENERGY SERVICES              | 1.587  | USD          | 14.585   | 0,01                              | STRYKER                         | 743    | USD          | 266.596   | 0,10                              |
| SELECT MEDICAL HOLDINGS             | 6.921  | USD          | 209.014  | 0,08                              | SUMMIT MATERIALS                | 715    | USD          | 31.946    | 0,01                              |
| SEMPRA                              | 1.506  | USD          | 108.010  | 0,04                              | SW AIRLINES                     | 15.395 | USD          | 453.383   | 0,17                              |
| SERVICE CORPORATION INTER- NATIONAL | 1.444  | USD          | 107.246  | 0,04                              | SYLVAMO                         | 480    | USD          | 29.981    | 0,01                              |
| SERVICENOW                          | 94     | USD          | 71.957   | 0,03                              | SYNCHRONY FINANCIAL             | 6.919  | USD          | 296.963   | 0,11                              |
| SHERWIN WILLIAMS                    | 977    | USD          | 339.214  | 0,13                              | SYNNEX                          | 2.904  | USD          | 329.110   | 0,12                              |
| SILGAN HOLDINGS                     | 1.584  | USD          | 76.776   | 0,03                              | SYNOPSIS                        | 209    | USD          | 120.108   | 0,05                              |
| SILICON LABORATORIES                | 230    | USD          | 33.088   | 0,01                              | SYNOVUS FINANCIAL               | 904    | USD          | 36.404    | 0,01                              |
| SIMON PROPERTY GROUP                | 1.366  | USD          | 212.194  | 0,08                              | SYSCO                           | 3.302  | USD          | 268.882   | 0,10                              |
| SINCLAIR                            | 6.708  | USD          | 90.893   | 0,03                              | T ROWE PRICE GROUP              | 2.121  | USD          | 258.592   | 0,10                              |
| SIRIUS XM HOLDINGS                  | 25.823 | USD          | 100.581  | 0,04                              | TAKE TWO INTERACTIVE SOFTWARE   | 314    | USD          | 46.896    | 0,02                              |
| SITE CENTER REIT                    | 1.569  | USD          | 22.947   | 0,01                              | TANGO HOLDINGS                  | 1.180  | USD          | 133.482   | 0,05                              |
| SKECHERS „A“                        | 911    | USD          | 55.589   | 0,02                              | TARGA RESOURCES                 | 488    | USD          | 54.500    | 0,02                              |
| SKYLINE CHAMPION                    | 524    | USD          | 45.221   | 0,02                              | TARGET                          | 9.509  | USD          | 1.668.164 | 0,63                              |
| SKYWEST                             | 1.155  | USD          | 80.688   | 0,03                              | TASKUS                          | 11.423 | USD          | 134.220   | 0,05                              |
| SKYWORKS SOLUTIONS                  | 865    | USD          | 94.034   | 0,04                              | TAYLOR MORRISON HOME „A“        | 559    | USD          | 34.977    | 0,01                              |
| SL GREEN REALTY                     | 1.265  | USD          | 69.297   | 0,03                              | TEGNA                           | 2.845  | USD          | 42.391    | 0,02                              |
| SLEEP NUMBER CORP                   | 357    | USD          | 5.705    | 0,00                              | TELEDYNE TECHNOLOGIES           | 106    | USD          | 45.767    | 0,02                              |
| SLM                                 | 2.446  | USD          | 53.433   | 0,02                              |                                 |        |              |           |                                   |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Economic Scale US Equity (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung                  | Anzahl | Wäh-<br>rung | Kurswert  | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens | Beschreibung            | Anzahl | Wäh-<br>rung | Kurswert  | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |
|-------------------------------|--------|--------------|-----------|-----------------------------------|-------------------------|--------|--------------|-----------|-----------------------------------|
| TELEFLEX                      | 235    | USD          | 52.783    | 0,02                              | ULTA SALON COSMETICS    |        |              |           |                                   |
| TELEPHONE & DATA<br>SYSTEMS   | 4.098  | USD          | 65.773    | 0,02                              | AND FRAGRANCE           | 347    | USD          | 180.627   | 0,07                              |
| TEMPUR-PEDIC<br>INTERNATIONAL | 1.200  | USD          | 68.160    | 0,03                              | UMB FINANCIAL           | 392    | USD          | 34.053    | 0,01                              |
| TENET HEALTHCARE              | 6.098  | USD          | 642.119   | 0,24                              | UNDER ARMOUR „A“        | 7.671  | USD          | 56.574    | 0,02                              |
| TERADATA                      | 1.148  | USD          | 44.852    | 0,02                              | UNIFIRST                | 239    | USD          | 42.136    | 0,02                              |
| TERADYNE                      | 682    | USD          | 77.046    | 0,03                              | UNION PACIFIC           | 2.749  | USD          | 675.649   | 0,25                              |
| TEREX                         | 504    | USD          | 32.689    | 0,01                              | UNITED BANKSHARES       | 737    | USD          | 26.377    | 0,01                              |
| TESLA MOTORS                  | 1.675  | USD          | 296.241   | 0,11                              | UNITED NATURAL FOODS    | 4.665  | USD          | 55.140    | 0,02                              |
| TETRA TECH                    | 505    | USD          | 93.703    | 0,04                              | UNITED PARCEL SERVICES  | 14.631 | USD          | 2.172.996 | 0,82                              |
| TEXAS INSTRUMENTS             | 2.763  | USD          | 482.337   | 0,18                              | UNITED RENTALS          | 394    | USD          | 284.106   | 0,11                              |
| TEXAS PACIFIC LAND REITS      | 135    | USD          | 77.448    | 0,03                              | UNITED STATES STEEL     | 3.602  | USD          | 148.258   | 0,06                              |
| TEXAS ROADHOUSE               | 599    | USD          | 92.665    | 0,03                              | UNITEDHEALTH GP         | 3.563  | USD          | 1.755.668 | 0,66                              |
| THE CHEMOURS                  | 1.759  | USD          | 47.176    | 0,02                              | UNIVERSAL               | 1.095  | USD          | 56.776    | 0,02                              |
| THE CLOROX                    | 609    | USD          | 92.745    | 0,03                              | UNIVERSAL HEALTH        |        |              |           |                                   |
| THE MOSAIC                    | 3.792  | USD          | 121.685   | 0,05                              | SERVICES „B“            | 2.343  | USD          | 428.230   | 0,16                              |
| THE ODP CORPORATION           | 2.520  | USD          | 134.870   | 0,05                              | UNUM GROUP              | 1.241  | USD          | 66.456    | 0,03                              |
| THE WENDY'S COMPANY           | 1.646  | USD          | 30.887    | 0,01                              | URBAN OUTFITTERS        | 1.643  | USD          | 71.060    | 0,03                              |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC      | 1.042  | USD          | 603.464   | 0,23                              | US BANCORP              | 15.648 | USD          | 699.622   | 0,26                              |
| THOR INDUSTRIES               | 968    | USD          | 113.440   | 0,04                              | US CELLULAR             | 1.107  | USD          | 41.197    | 0,02                              |
| THOUGHTWORKS HOLDING          | 5.701  | USD          | 14.024    | 0,01                              | US FOODS HOLDING CORP   | 1.746  | USD          | 95.017    | 0,04                              |
| TIDEWATER                     | 426    | USD          | 39.431    | 0,01                              | VAIL RESORTS            | 115    | USD          | 25.635    | 0,01                              |
| TIMKEN                        | 1.087  | USD          | 95.623    | 0,04                              | VALARIS                 | 624    | USD          | 47.181    | 0,02                              |
| TITAN INTERNATIONAL           | 375    | USD          | 4.710     | 0,00                              | VALERO ENERGY           | 2.717  | USD          | 458.738   | 0,17                              |
| TJX                           | 10.462 | USD          | 1.065.973 | 0,40                              | VALLEY NATIONAL BANCORP | 1.616  | USD          | 12.847    | 0,00                              |
| T-MOBILE US                   | 6.507  | USD          | 1.065.066 | 0,40                              | VALMONT INDUSTRIES      | 236    | USD          | 54.313    | 0,02                              |
| TOAST INC                     | 2.387  | USD          | 58.291    | 0,02                              | VALVOLINE               | 887    | USD          | 39.498    | 0,01                              |
| TOLL BROTHERS                 | 684    | USD          | 88.899    | 0,03                              | VECTRUS                 | 254    | USD          | 12.045    | 0,00                              |
| TOPBUILD                      | 83     | USD          | 36.727    | 0,01                              | VEEVA SYSTEMS „A“       | 81     | USD          | 18.929    | 0,01                              |
| TORO                          | 495    | USD          | 44.619    | 0,02                              | VENTAS                  | 1.934  | USD          | 84.187    | 0,03                              |
| TPG                           | 328    | USD          | 14.826    | 0,01                              | VERALTO CORP            | 481    | USD          | 43.035    | 0,02                              |
| TPI COMPOSITES                | 12.539 | USD          | 37.178    | 0,01                              | VERISIGN                | 201    | USD          | 38.116    | 0,01                              |
| TRACTOR SUPPLY                | 699    | USD          | 183.096   | 0,07                              | VERISK ANALYTICS        | 417    | USD          | 98.074    | 0,04                              |
| TRANSDIGM GROUP               | 54     | USD          | 66.631    | 0,03                              | VERIZON COMMUNICATIONS  | 45.933 | USD          | 1.922.296 | 0,72                              |
| TRANSOCEAN                    | 14.237 | USD          | 89.907    | 0,03                              | VERTEX PHARMACEUTICALS  | 185    | USD          | 77.661    | 0,03                              |
| TRANSUNION                    | 494    | USD          | 39.787    | 0,01                              | VERTIV HOLDINGS         | 2.172  | USD          | 178.951   | 0,07                              |
| TRAVEL PLUS LEISURE           | 1.256  | USD          | 61.004    | 0,02                              | VESTIS CORP             | 4.156  | USD          | 79.961    | 0,03                              |
| TRAVELERS COMPANIES           | 1.483  | USD          | 340.927   | 0,13                              | VF                      | 12.030 | USD          | 184.661   | 0,07                              |
| TREEHOUSE FOODS               | 1.233  | USD          | 48.395    | 0,02                              | VIACOMCBS               | 13.808 | USD          | 164.177   | 0,06                              |
| TRIMBLE NAVIGATION            | 1.085  | USD          | 68.800    | 0,03                              | VIASAT                  | 1.121  | USD          | 20.425    | 0,01                              |
| TRINET GROUP                  | 231    | USD          | 30.693    | 0,01                              | VIATRIS                 | 34.483 | USD          | 408.451   | 0,15                              |
| TRINITY INDUSTRIES            | 1.632  | USD          | 45.794    | 0,02                              | VIAVI SOLUTIONS         | 3.153  | USD          | 28.992    | 0,01                              |
| TRIUMPH GROUP                 | 2.843  | USD          | 43.867    | 0,02                              | VICTORIA'S SECRET       | 1.494  | USD          | 28.909    | 0,01                              |
| TRUEBLUE                      | 1.476  | USD          | 18.671    | 0,01                              | VIRTU FINANCIAL         | 2.502  | USD          | 51.866    | 0,02                              |
| TRUIST FINANCIAL              | 14.500 | USD          | 563.108   | 0,21                              | VISA „A“                | 3.101  | USD          | 863.163   | 0,32                              |
| TTEC HOLDINGS                 | 11.114 | USD          | 118.475   | 0,04                              | VISHAY INTERTECHNOLOGY  | 4.654  | USD          | 106.995   | 0,04                              |
| TTM TECHNOLOGIES              | 4.721  | USD          | 74.356    | 0,03                              | VISTA OUTDOOR           | 1.158  | USD          | 38.145    | 0,01                              |
| TYLER TECHNOLOGIES            | 76     | USD          | 32.148    | 0,01                              | VISTEON                 | 400    | USD          | 47.548    | 0,02                              |
| TYSON FOODS „A“               | 12.808 | USD          | 754.519   | 0,28                              | VISTRA ENERGY CORP      | 3.558  | USD          | 246.676   | 0,09                              |
| UBER TECHNOLOGIES             | 954    | USD          | 74.145    | 0,03                              | VONTIER                 | 857    | USD          | 38.668    | 0,01                              |
| UFP INDUSTRIES                | 553    | USD          | 68.185    | 0,03                              | VORNADO REALTY TRUST    | 1.580  | USD          | 45.093    | 0,02                              |
| UGI                           | 2.143  | USD          | 52.343    | 0,02                              | VOYA FINANCIAL          | 925    | USD          | 68.598    | 0,03                              |
|                               |        |              |           |                                   | VULCAN MATERIALS        | 365    | USD          | 99.933    | 0,04                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Economic Scale US Equity (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung           | Anzahl  | Wäh-<br>rung | Kurswert  | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens | Beschreibung   | Anzahl  | Wäh-<br>rung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |
|------------------------|---------|--------------|-----------|-----------------------------------|--|---------|--------------|--------------------|-----------------------------------|
| W.R. BERKLEY           | 872     | USD          | 77.250    | 0,03                              | YUM BRANDS   | 947     | USD          | 131.207            | 0,05                              |
| WABASH NATIONAL        | 761     | USD          | 22.373    | 0,01                              | ZEBRA TECHNOLOGIES „A“   | 248     | USD          | 74.752             | 0,03                              |
| WABTEC                 | 1.909   | USD          | 277.473   | 0,10                              | ZILLOW GROUP   | 778     | USD          | 38.737             | 0,01                              |
| WAL MART STORES        | 128.758 | USD          | 7.788.570 | 2,94                              | ZIMMER HOLDINGS  | 1.418   | USD          | 187.701            | 0,07                              |
| WALGREENS BOOTS        |         |              |           |                                   | ZIONS BANCORP  | 2.091   | USD          | 90.540             | 0,03                              |
| ALLIANCE               | 46.945  | USD          | 998.990   | 0,38                              | ZOETIS   | 593     | USD          | 101.160            | 0,04                              |
| WALKER & DUNLOP        | 97      | USD          | 9.781     | 0,01                              | ZOOM VIDEO   |         |              |                    |                                   |
| WALT DISNEY            | 14.551  | USD          | 1.788.463 | 0,67                              | COMMUNICATIONS   | 532     | USD          | 35.266             | 0,01                              |
| WASTE MAN              | 1.917   | USD          | 408.359   | 0,15                              | ZUMIEZ   | 1.448   | USD          | 21.995             | 0,01                              |
| WATERS                 | 306     | USD          | 105.295   | 0,04                              | ZURN WATER SOLUTIONS   | 803     | USD          | 27.029             | 0,01                              |
| WATSCO                 | 79      | USD          | 34.379    | 0,01                              |  |         |              | <b>250.615.029</b> | <b>94,34</b>                      |
| WATTS WATER            |         |              |           |                                   |  |         |              | <b>261.791.625</b> | <b>98,54</b>                      |
| TECHNOLOGIES           | 168     | USD          | 35.717    | 0,01                              | <b>SUMME AKTIEN</b>  |         |              |                    |                                   |
| WAYFAIR „A“            | 134     | USD          | 9.275     | 0,00                              | <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN</b>                              |         |              |                    |                                   |
| WEBSTER FINANCIAL      | 1.871   | USD          | 95.683    | 0,04                              | <b>BÖRSE NOTIERTEN WERTPAPIERE</b>                               |         |              | <b>261.791.625</b> | <b>98,54</b>                      |
| WEC ENERGY GROUP       | 645     | USD          | 52.664    | 0,02                              | <b>WERTPAPIERE</b>   |         |              |                    |                                   |
| WEIS MARKETS           | 869     | USD          | 55.903    | 0,02                              | <b>AN EINEM ANDEREM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE, ÜBERTRAGBARE</b> |         |              |                    |                                   |
| WELLS FARGO            | 55.032  | USD          | 3.187.452 | 1,21                              | <b>WERTPAPIERE</b>   |         |              |                    |                                   |
| WERNER ENTERPRISES     | 1.438   | USD          | 56.542    | 0,02                              | <b>AKTIEN</b>  |         |              |                    |                                   |
| WESCO INTERNATIONAL    | 168     | USD          | 28.864    | 0,01                              | <b>GROSSBRITANNIEN</b>   |         |              |                    |                                   |
| WEST PHARMACEUTICAL    |         |              |           |                                   | TECHNIPFMC   | 9.022   | USD          | 227.084            | 0,09                              |
| SERVICES               | 148     | USD          | 58.752    | 0,02                              |  |         |              | <b>227.084</b>     | <b>0,09</b>                       |
| WESTERN DIGITAL        | 8.427   | USD          | 578.008   | 0,22                              | <b>IRLAND</b>  |         |              |                    |                                   |
| WESTERN UNION          | 6.863   | USD          | 94.881    | 0,04                              | ADIANT   | 10.103  | USD          | 338.754            | 0,13                              |
| WESTLAKE CHEMICAL      | 743     | USD          | 113.501   | 0,04                              |  |         |              | <b>338.754</b>     | <b>0,13</b>                       |
| WESTROCK               | 7.219   | USD          | 354.309   | 0,13                              | <b>USA</b>   |         |              |                    |                                   |
| WEX                    | 131     | USD          | 31.085    | 0,01                              | ALCOA UPSTREAM   | 3.131   | USD          | 106.016            | 0,04                              |
| WEYERHAEUSER           | 4.694   | USD          | 168.843   | 0,06                              | CONDUENT   | 102.252 | USD          | 350.213            | 0,14                              |
| WHIRLPOOL              | 2.821   | USD          | 335.304   | 0,13                              | CORECIVIC REIT   | 3.173   | USD          | 50.260             | 0,02                              |
| WIDEPENWEST            | 2.974   | USD          | 10.796    | 0,00                              | HILLTOP HOLDINGS   | 1.692   | USD          | 53.213             | 0,02                              |
| WILLIAMS COMPANIES     | 5.203   | USD          | 202.189   | 0,08                              | HILTON WORLDWIDE   |         |              |                    |                                   |
| WILLIAMS SONOMA        | 462     | USD          | 147.378   | 0,06                              | HOLDINGS   | 1.255   | USD          | 269.398            | 0,10                              |
| WILLSCOT MOBILE MINI   |         |              |           |                                   | HOULIHAN LOKEY   | 444     | USD          | 56.992             | 0,02                              |
| HOLDINGS               | 800     | USD          | 37.104    | 0,01                              | IHEARTMEDIA  | 23.727  | USD          | 50.657             | 0,02                              |
| WINNEBAGO INDUSTRIES   | 382     | USD          | 28.119    | 0,01                              | LAMB WESTON HOLDINGS   | 170     | USD          | 18.195             | 0,01                              |
| WINTRUST FINANCIAL     | 358     | USD          | 37.608    | 0,01                              | NATIONAL HEALTHCARE  | 374     | USD          | 35.324             | 0,01                              |
| WK KELLOGG             | 832     | USD          | 15.450    | 0,01                              | PARK HOTELS & RESORTS  |         |              |                    |                                   |
| WOLVERINE WORLD WIDE   | 1.791   | USD          | 19.898    | 0,01                              | REIT   | 1.720   | USD          | 30.306             | 0,01                              |
| WOODWARD               | 327     | USD          | 50.924    | 0,02                              | PLAINS GP HOLDINGS LP  |         |              |                    |                                   |
| WORKDAY „A“            | 206     | USD          | 56.606    | 0,02                              | INT CL COM A NPV   | 4.772   | USD          | 86.803             | 0,03                              |
| WORLD FUEL SERVICES    | 492     | USD          | 13.077    | 0,00                              | RESTORATION HARDWARE   |         |              |                    |                                   |
| WORTHINGTON INDUSTRIES | 675     | USD          | 42.309    | 0,02                              | HOLDING  | 31      | USD          | 10.771             | 0,00                              |
| WP CAREY REIT          | 294     | USD          | 16.540    | 0,01                              | SBA COMMUNICATIONS   | 174     | USD          | 37.967             | 0,01                              |
| WW INTERNATIONAL       | 2.156   | USD          | 4.010     | 0,00                              | SEABOARD   | 19      | USD          | 61.533             | 0,02                              |
| WYNDHAM HOTELS AND     |         |              |           |                                   | WELLTOWER  | 227     | USD          | 21.125             | 0,01                              |
| RESORTS                | 602     | USD          | 46.179    | 0,02                              |  |         |              | <b>1.238.773</b>   | <b>0,46</b>                       |
| WYNN RESORTS           | 565     | USD          | 57.602    | 0,02                              | <b>SUMME AKTIEN</b>  |         |              |                    |                                   |
| XCEL ENERGY            | 1.058   | USD          | 56.751    | 0,02                              | <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN</b>                              |         |              |                    |                                   |
| XEROX HOLDINGS         | 9.937   | USD          | 177.574   | 0,07                              | <b>MARKT GEHANDELTEN ÜBERTRAGBAREN</b>                           |         |              | <b>1.804.611</b>   | <b>0,68</b>                       |
| XPO LOGISTICS          | 1.829   | USD          | 223.668   | 0,08                              | <b>WERTPAPIERE</b>   |         |              |                    |                                   |
| XYLEM INCORPORATED     | 897     | USD          | 116.323   | 0,04                              |  |         |              |                    |                                   |
| YELP                   | 874     | USD          | 34.672    | 0,01                              |  |         |              |                    |                                   |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Economic Scale US Equity (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung                                   | Anzahl | Wäh-<br>rung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |
|--|--------|--------------|--------------------|-----------------------------------|
| <b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>       |        |              |                    |                                   |
| <b>USA</b>                                     |        |              |                    |                                   |
| EXTRA SPACE STORAGE                            | 194    | USD          | 28.590             | 0,01                              |
| MIDAMERICA APARTMENT                           | 489    | USD          | 64.361             | 0,03                              |
| OMEGA HEALTHCARE                               |        |              |                    |                                   |
| INVESTORS                                      | 1.155  | USD          | 36.152             | 0,01                              |
|  |        |              | <u>129.103</u>     | <u>0,05</u>                       |
| <b>SUMME ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b> |        |              | <b>129.103</b>     | <b>0,05</b>                       |
| <b>SUMME WERTPAPIERANLAGEN</b>                 |        |              | <b>263.725.339</b> | <b>99,27</b>                      |
| <b>SONSTIGES NETTOVERMÖGEN</b>                 |        |              | <b>1.931.981</b>   | <b>0,73</b>                       |
| <b>GESAMTNETTOVERMÖGEN</b>                     |        |              | <b>265.657.320</b> | <b>100,00</b>                     |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Indian Equity  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl     | Wäh-<br>rung | Kurswert    | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens | Beschreibung                                   | Anzahl     | Wäh-<br>rung | Kurswert             | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |
|---|------------|--------------|-------------|-----------------------------------|--|------------|--------------|----------------------|-----------------------------------|
| <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>  |            |              |             |                                   |  |            |              |                      |                                   |
| <b>AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |            |              |             |                                   |  |            |              |                      |                                   |
| <b>AKTIEN</b>   |            |              |             |                                   |  |            |              |                      |                                   |
| <b>INDIEN</b>   |            |              |             |                                   |  |            |              |                      |                                   |
| APOLLO HOSPITALS  |            |              |             |                                   | TATA CONSULTANCY                               |            |              |                      |                                   |
| ENTERPRISE  | 279.612    | INR          | 21.311.562  | 1,51                              | SERVICE  | 216.350    | INR          | 10.055.304           | 0,71                              |
| ASIAN PAINTS  | 430.859    | INR          | 14.706.368  | 1,04                              | TATA MOTORS                                    | 1.929.144  | INR          | 22.963.990           | 1,63                              |
| AVENUE SUPERMARTS   | 245.864    | INR          | 13.341.112  | 0,94                              | TATA TECHNOLOGIES                              | 116.905    | INR          | 1.430.572            | 0,10                              |
| AXIS BANK   | 3.200.000  | INR          | 40.179.131  | 2,84                              | TECH MAHINDRA                                  | 959.300    | INR          | 14.355.713           | 1,02                              |
| BHARAT ELECTRONICS  | 8.500.000  | INR          | 20.535.955  | 1,45                              | TITAN INDUSTRIES                               | 700.000    | INR          | 31.908.636           | 2,26                              |
| BHARTI AIRTEL   | 1.250.000  | INR          | 18.413.717  | 1,30                              | TVS MOTOR COMPANY                              | 500.000    | INR          | 12.900.393           | 0,91                              |
| BLUE STAR   | 640.903    | INR          | 9.787.694   | 0,69                              | ULTRATECH CEMENT                               | 296.074    | INR          | 34.608.913           | 2,45                              |
| CADILA HEALTHCARE   | 1.500.000  | INR          | 18.117.263  | 1,28                              | UNITED SPIRITS                                 | 600.000    | INR          | 8.159.827            | 0,58                              |
| CONCORD BIOTECH   | 837.277    | INR          | 15.267.298  | 1,08                              | VARUN BEVERAGES                                | 582.227    | INR          | 9.763.528            | 0,69                              |
| DALMIA BHARAT   | 732.194    | INR          | 17.050.215  | 1,21                              | ZOMATO   | 15.186.629 | INR          | 33.158.300           | 2,35                              |
| DELHIVERY   | 1.200.000  | INR          | 6.410.599   | 0,45                              |  |            |              | <b>1.306.507.909</b> | <b>92,46</b>                      |
| DLF   | 5.984.223  | INR          | 64.360.758  | 4,55                              | <b>USA</b>                                     |            |              |                      |                                   |
| ESCORTS LIMITED   | 393.489    | INR          | 13.103.168  | 0,93                              | COGNIZANT TECHNOLOGY                           |            |              |                      |                                   |
| EXIDE INDUSTRIES  | 4.818.281  | INR          | 17.594.286  | 1,25                              | SOLUTIONS                                      | 286.438    | USD          | 21.099.023           | 1,49                              |
| FSN E-COMMERCE  |            |              |             |                                   |  |            |              | <b>21.099.023</b>    | <b>1,49</b>                       |
| VENTURES  | 2.029.622  | INR          | 3.941.096   | 0,28                              |  |            |              | <b>1.327.606.932</b> | <b>93,95</b>                      |
| GODREJ CONSUMER   |            |              |             |                                   | <b>SUMME AKTIEN</b>                            |            |              |                      |                                   |
| PRODUCTS  | 1.000.000  | INR          | 15.009.142  | 1,06                              |  |            |              | <b>1.327.606.932</b> | <b>93,95</b>                      |
| HCL TECHNOLOGIES  | 932.028    | INR          | 17.249.265  | 1,22                              | <b>DEPOSITARY RECEIPTS</b>                     |            |              |                      |                                   |
| HDFC BANK   | 6.048.510  | INR          | 105.004.499 | 7,43                              | <b>INDIEN</b>                                  |            |              |                      |                                   |
| HINDUSTAN UNILEVER  | 862.594    | INR          | 23.419.139  | 1,66                              | HDFC BANK                                      | 52.652     | USD          | 2.937.982            | 0,21                              |
| ICICI BANK  | 2.337.458  | INR          | 30.641.082  | 2,17                              | ICICI BANK                                     | 2.121.631  | USD          | 56.095.923           | 3,96                              |
| INDUSIND BANK   | 1.100.000  | INR          | 20.482.599  | 1,45                              | INFOSYS  | 2.842.234  | USD          | 51.089.156           | 3,62                              |
| INFOSYS   | 1.989.039  | INR          | 35.726.505  | 2,53                              |  |            |              | <b>110.123.061</b>   | <b>7,79</b>                       |
| JINDAL STAINLESS  | 1.019.355  | INR          | 8.487.648   | 0,60                              |  |            |              | <b>110.123.061</b>   | <b>7,79</b>                       |
| JINDAL STEEL & POWER  | 3.461.104  | INR          | 35.238.709  | 2,49                              | <b>SUMME DEPOSITARY RECEIPTS</b>               |            |              |                      |                                   |
| LARSEN & TOUBRO   | 1.816.873  | INR          | 81.994.285  | 5,80                              | <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN</b>            |            |              |                      |                                   |
| LUPIN   | 1.000.000  | INR          | 19.385.510  | 1,37                              | <b>BÖRSE NOTIERTEN WERTPAPIERE</b>             |            |              |                      |                                   |
| MAHINDRA & MAHINDRA   | 410.456    | INR          | 9.455.707   | 0,67                              | <b>WERTPAPIERE</b>                             |            |              |                      |                                   |
| MANKIND PHARMA  | 485.865    | INR          | 13.403.122  | 0,95                              | <b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>       |            |              |                      |                                   |
| MARUTI SUZUKI INDIA   | 159.293    | INR          | 24.065.796  | 1,70                              | <b>IRLAND</b>                                  |            |              |                      |                                   |
| MULTI COMMODITY   |            |              |             |                                   | HSBC GLOBAL LIQUIDITY                          |            |              |                      |                                   |
| EXCHANGE OF INDIA   | 772.218    | INR          | 31.013.716  | 2,19                              | FUND   | 7.458.521  | USD          | 7.458.521            | 0,53                              |
| ONGC  | 12.427.065 | INR          | 39.939.747  | 2,83                              |  |            |              | <b>7.458.521</b>     | <b>0,53</b>                       |
| PB FINTECH  | 1.400.000  | INR          | 18.871.736  | 1,34                              | <b>SUMME ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b> |            |              |                      |                                   |
| PHOENIX MILLS   | 723.814    | INR          | 24.150.710  | 1,71                              | <b>SUMME WERTPAPIERANLAGEN</b>                 |            |              |                      |                                   |
| PI INDUSTRIES   | 591.818    | INR          | 27.443.850  | 1,94                              | <b>1.445.188.514 102,27</b>                    |            |              |                      |                                   |
| RELIANCE INDUSTRIES   | 3.053.129  | INR          | 108.785.510 | 7,69                              | <b>SONSTIGE NETTOVERBINDLICHKEITEN</b>         |            |              |                      |                                   |
| SBI CARDS AND PAYMENT   |            |              |             |                                   | <b>(32.105.499) (2,27)</b>                     |            |              |                      |                                   |
| SERVICES  | 2.788.990  | INR          | 22.824.557  | 1,62                              | <b>GESAMTNETTOVERMÖGEN</b>                     |            |              |                      |                                   |
| SBI LIFE INSURANCE  | 1.200.000  | INR          | 21.585.684  | 1,53                              | <b>1.413.083.015 100,00</b>                    |            |              |                      |                                   |
| SHRIRAM TRANSPORT   |            |              |             |                                   |  |            |              |                      |                                   |
| FINANCE   | 459.895    | INR          | 13.012.322  | 0,92                              |  |            |              |                      |                                   |
| STATE BANK OF INDIA   | 3.000.000  | INR          | 27.062.138  | 1,92                              |  |            |              |                      |                                   |
| SUN PHARMACEUTICALS   | 2.900.000  | INR          | 56.348.372  | 3,99                              |  |            |              |                      |                                   |
| SUNDARAM FINANCE  | 50.000     | INR          | 2.481.161   | 0,18                              |  |            |              |                      |                                   |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Russia Equity\*

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung                             | Anzahl    | Wäh-<br>rung | Kurswert | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens | Beschreibung   | Anzahl    | Wäh-<br>rung | Kurswert   | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |
|--|-----------|--------------|----------|-----------------------------------|--|-----------|--------------|------------|-----------------------------------|
| <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>                 |           |              |          |                                   | TATNEFT**  | 54.024    | USD          | -          | 0,00                              |
| <b>SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |           |              |          |                                   | TCS GROUP HOLDINGS**                                       | 83.124    | USD          | -          | 0,00                              |
| <b>AKTIEN</b>                            |           |              |          |                                   | <b>SUMME DEPOSITARY RECEIPTS</b>                           |           |              | -          | <b>0,00</b>                       |
| <b>GROSSBRITANNIEN</b>                   |           |              |          |                                   | <b>VORZUGSAKTIEN</b>                                       |           |              | -          | <b>0,00</b>                       |
| <b>POLYMETAL</b>                         |           |              |          |                                   | <b>RUSSISCHE FÖDERATION</b>                                |           |              | -          | <b>0,00</b>                       |
| INTERNATIONAL**                          | 15.451    | RUB          | -        | 0,00                              | SURGUTNEFTEGAZ**   | 2.602.900 | RUB          | -          | 0,00                              |
|  |           |              | -        | <b>0,00</b>                       | <b>SUMME VORZUGSAKTIEN</b>                                 |           |              | -          | <b>0,00</b>                       |
| <b>NIEDERLANDE</b>                       |           |              |          |                                   | <b>SUMME SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>             |           |              | -          | <b>0,00</b>                       |
| YANDEX**                                 | 26.811    | USD          | -        | 0,00                              | <b>SUMME WERTPAPIERANLAGEN</b>                             |           |              | -          | <b>0,00</b>                       |
| YANDEX (NL0009805522)**                  | 140.775   | RUB          | -        | 0,00                              | <b>SONSTIGES NETTOVERMÖGEN ABZÜGLICH VERBINDLICHKEITEN</b> |           |              | 11.787.329 | 100,00                            |
|  |           |              | -        | <b>0,00</b>                       | <b>GESAMTNETTOVERMÖGEN</b>                                 |           |              | 11.787.329 | 100,00                            |
| <b>RUSSISCHE FÖDERATION</b>              |           |              |          |                                   |  |           |              |            |                                   |
| ALROSA**                                 | 1.194.750 | RUB          | -        | 0,00                              |  |           |              |            |                                   |
| GAZPROM NEFT CLS**                       | 620.390   | RUB          | -        | 0,00                              |  |           |              |            |                                   |
| GAZPROM**                                | 213.540   | RUB          | -        | 0,00                              |  |           |              |            |                                   |
| LUKOIL**                                 | 13.760    | RUB          | -        | 0,00                              |  |           |              |            |                                   |
| MAGNIT**                                 | 80.475    | RUB          | -        | 0,00                              |  |           |              |            |                                   |
| MOSCOW EXCHANGE MICEX**                  | 876.470   | RUB          | -        | 0,00                              |  |           |              |            |                                   |
| PHOSAGRO**                               | 35.849    | RUB          | -        | 0,00                              |  |           |              |            |                                   |
| POLYUS GOLD**                            | 33.542    | RUB          | -        | 0,00                              |  |           |              |            |                                   |
| ROSNEFT OIL**                            | 142.685   | RUB          | -        | 0,00                              |  |           |              |            |                                   |
| SBERBANK**                               | 1.902.100 | RUB          | -        | 0,00                              |  |           |              |            |                                   |
| SEGEZHA GROUP**                          |           | RUB          | -        | 0,00                              |  |           |              |            |                                   |
| SURGUTNEFTEGAZ CLS**                     | 1.260.000 | RUB          | -        | 0,00                              |  |           |              |            |                                   |
| TATNEFT**                                | 450.466   | RUB          | -        | 0,00                              |  |           |              |            |                                   |
| UNITED RUSAL INTERNATIONAL**             | 2.703.400 | RUB          | -        | 0,00                              |  |           |              |            |                                   |
|  |           |              | -        | <b>0,00</b>                       |  |           |              |            |                                   |
| <b>SUMME AKTIEN</b>                      |           |              | -        | <b>0,00</b>                       |  |           |              |            |                                   |
| <b>DEPOSITARY RECEIPTS</b>               |           |              |          |                                   |  |           |              |            |                                   |
| <b>ZYPERN</b>                            |           |              |          |                                   |  |           |              |            |                                   |
| OZON HOLDINGS**                          | 54.741    | RUB          | -        | 0,00                              |  |           |              |            |                                   |
|  |           |              | -        | <b>0,00</b>                       |  |           |              |            |                                   |
| <b>NIEDERLANDE</b>                       |           |              |          |                                   |  |           |              |            |                                   |
| X5 RETAIL GROUP**                        | 131.652   | USD          | -        | 0,00                              |  |           |              |            |                                   |
|  |           |              | -        | <b>0,00</b>                       |  |           |              |            |                                   |
| <b>RUSSISCHE FÖDERATION</b>              |           |              |          |                                   |  |           |              |            |                                   |
| JSC MMC NORILSK NICKEL**                 | 150.280   | USD          | -        | 0,00                              |  |           |              |            |                                   |
| LUKOIL**                                 | 133.476   | USD          | -        | 0,00                              |  |           |              |            |                                   |
| NOVATEK**                                | 29.077    | USD          | -        | 0,00                              |  |           |              |            |                                   |
| NOVOLIPETSK STEEL**                      | 146.086   | USD          | -        | 0,00                              |  |           |              |            |                                   |
| OAO GAZPROM**                            | 1.027.252 | USD          | -        | 0,00                              |  |           |              |            |                                   |
| ROSNEFT OIL**                            | 739.463   | USD          | -        | 0,00                              |  |           |              |            |                                   |
| SEVERSTAL**                              | 202.129   | USD          | -        | 0,00                              |  |           |              |            |                                   |

\* Der Handel und die Berechnung des offiziellen Nettoinventarwerts des Teilfonds Russia Equity sind seit 25. Februar 2022 aufgrund der Schließung der Moskauer Börse ausgesetzt,

\*\* Aufgrund der Marktgegebenheiten infolge der Ukraine- und Russland-Krise seit dem 25. Februar 2022 haben der Ausschuss für die Preisbestimmung und die Verwaltungsgesellschaft vereinbart und veranlasst, dass alle Wertpapiere im Anlageportfolio auf null abgeschrieben werden,

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Turkey Equity  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in EUR)

| Beschreibung  | Anzahl     | Wäh-<br>rung | Kurswert  | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens | Beschreibung  | Anzahl  | Wäh-<br>rung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |
|---|------------|--------------|-----------|-----------------------------------|---|---------|--------------|-------------------|-----------------------------------|
| <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>  |            |              |           |                                   | YAPI KREDI BANK   |         |              |                   |                                   |
| <b>AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |            |              |           |                                   | 7.500.000 TRY 5.902.950 6,20  |         |              |                   |                                   |
| <b>AKTIEN</b>   |            |              |           |                                   | <b>SUMME AKTIEN</b>   |         |              |                   |                                   |
| <b>TÜRKEI</b>   |            |              |           |                                   | <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTEN WERTPAPIERE</b>                 |         |              |                   |                                   |
| AKBANK  | 3.600.000  | TRY          | 4.819.898 | 5,06                              |   |         |              | <b>85.826.997</b> | <b>90,14</b>                      |
| ANADOLU EFES BIRACILIK  | 350.000    | TRY          | 1.514.590 | 1,59                              |   |         |              | <b>85.826.997</b> | <b>90,14</b>                      |
| ASELSAN ELEKTRONIK  |            |              |           |                                   | <b>AN EINEM ANDEREM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE, ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>    |         |              |                   |                                   |
| SANAYI VE TICARET   | 1.500.000  | TRY          | 2.380.499 | 2,50                              | <b>AKTIEN</b>   |         |              |                   |                                   |
| BIM BIRLESIK MAGAZALAR  | 400.000    | TRY          | 4.024.023 | 4,23                              | <b>TÜRKEI</b>   |         |              |                   |                                   |
| BIOTREND CEVRE VE   |            |              |           |                                   | AG ANADOLU GRUBU  |         |              |                   |                                   |
| ENERJI YATIRIMLARI  | 1.400.000  | TRY          | 697.192   | 0,73                              | HOLDING   | 120.000 | TRY          | 937.603           | 0,98                              |
| EMLAK KONUT GAYRIMENKUL   |            |              |           |                                   | AKCANS A CEMENTO  | 650.000 | TRY          | 2.706.771         | 2,84                              |
| YATOTA  | 3.000.000  | TRY          | 830.277   | 0,87                              | AKSA AKRILIK KIMYA  |         |              |                   |                                   |
| EREGLI DEMIR VE CELIK   |            |              |           |                                   | SANAYII   | 200.000 | TRY          | 569.259           | 0,60                              |
| FABRIK  | 200.000    | TRY          | 241.098   | 0,25                              | ANADOLU SIGORTA   | 700.000 | TRY          | 1.382.363         | 1,45                              |
| FORD OTOMOTIV SANAYI  | 25.000     | TRY          | 826.413   | 0,87                              | PANELSAN CATI CEPHE   |         |              |                   |                                   |
| GALATA WIND ENERJI  | 1.100.001  | TRY          | 783.912   | 0,82                              | SISTEMLERI  | 600.000 | TRY          | 1.395.243         | 1,47                              |
| GARANTI BANKASI   | 1.800.000  | TRY          | 3.683.440 | 3,87                              |   |         |              | <b>6.991.239</b>  | <b>7,34</b>                       |
| GEN ILAC VE SAGLIK URUNLERI                                       |            |              |           |                                   | <b>SUMME AKTIEN</b>   |         |              |                   |                                   |
| SANAYI VE TICARET   | 200.000    | TRY          | 382.940   | 0,40                              | <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN MARKT GEHANDELTEN ÜBERTRAGBAREN WERTPAPIERE</b> |         |              |                   |                                   |
| KIMTEKS POLIURETAN  |            |              |           |                                   |   |         |              | <b>6.991.239</b>  | <b>7,34</b>                       |
| SANAYI VE TICARET   | 600.000    | TRY          | 987.402   | 1,04                              | <b>SUMME WERTPAPIERANLAGEN</b>  |         |              |                   |                                   |
| KOC HOLDING   | 730.000    | TRY          | 4.249.608 | 4,46                              | <b>SONSTIGES NETTOVERMÖGEN</b>  |         |              |                   |                                   |
| MAVI GIYIM SANAYI VE  |            |              |           |                                   | <b>GESAMTNETTOVERMÖGEN</b>  |         |              |                   |                                   |
| TICARET   | 1.400.000  | TRY          | 2.824.830 | 2,97                              |   |         |              | <b>92.818.236</b> | <b>97,48</b>                      |
| MEDITERA TIBBI MALZEME  |            |              |           |                                   |   |         |              | <b>2.397.588</b>  | <b>2,52</b>                       |
| SANAYI VE TICARET   | 500.000    | TRY          | 450.484   | 0,47                              |   |         |              | <b>95.215.824</b> | <b>100,00</b>                     |
| MIGROS TICARET  | 630.000    | TRY          | 7.361.085 | 7,73                              |   |         |              |                   |                                   |
| MLP SAGLIK HIZMETLERI   | 200.000    | TRY          | 1.046.360 | 1,10                              |   |         |              |                   |                                   |
| OTOKAR OTOMOTIV VE  |            |              |           |                                   |   |         |              |                   |                                   |
| SAVUNMA SANAYI  | 70.000     | TRY          | 927.586   | 0,97                              |   |         |              |                   |                                   |
| PEGASUS HAVA  |            |              |           |                                   |   |         |              |                   |                                   |
| TASIMACILIGI  | 60.000     | TRY          | 1.402.112 | 1,47                              |   |         |              |                   |                                   |
| PETKIM PETROKIMYA   |            |              |           |                                   |   |         |              |                   |                                   |
| HOLDING   | 3.300.000  | TRY          | 1.886.110 | 1,98                              |   |         |              |                   |                                   |
| SABANCI HOLDING   | 900.000    | TRY          | 2.135.365 | 2,24                              |   |         |              |                   |                                   |
| SOK MARKETLER TICARET   | 1.100.000  | TRY          | 1.822.831 | 1,91                              |   |         |              |                   |                                   |
| TOFAS TURK OTOMOBIL   |            |              |           |                                   |   |         |              |                   |                                   |
| FABRIKASI   | 400.000    | TRY          | 3.122.481 | 3,28                              |   |         |              |                   |                                   |
| TUPRAS-TURKIYE PETROL   |            |              |           |                                   |   |         |              |                   |                                   |
| RAFINE  | 300.000    | TRY          | 1.518.883 | 1,60                              |   |         |              |                   |                                   |
| TURK HAVA YOLLARI   | 1.050.000  | TRY          | 8.947.798 | 9,41                              |   |         |              |                   |                                   |
| TURK TELEKOMUNIKASYON   | 4.200.000  | TRY          | 3.707.138 | 3,89                              |   |         |              |                   |                                   |
| TURKCELL ILETISM  |            |              |           |                                   |   |         |              |                   |                                   |
| HIZMETLERI  | 4.400.000  | TRY          | 8.613.584 | 9,05                              |   |         |              |                   |                                   |
| TURKIYE IS BANKASI „C“  | 13.500.000 | TRY          | 4.338.990 | 4,56                              |   |         |              |                   |                                   |
| TURKIYE SIGORTA   | 3.100.000  | TRY          | 4.397.118 | 4,62                              |   |         |              |                   |                                   |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Asia Bond  
Aufstellung der Wertpapiieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung  | Nennwert  | Währung | Kurswert         | % des Nettovermögens | Beschreibung  | Nennwert  | Währung | Kurswert  | % des Nettovermögens |
|---|-----------|---------|------------------|----------------------|---|-----------|---------|-----------|----------------------|
| <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>  |           |         |                  |                      | <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>  |           |         |           |                      |
| <b>AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |           |         |                  |                      | <b>AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |           |         |           |                      |
| <b>ANLEIHEN</b>   |           |         |                  |                      | <b>ANLEIHEN</b>   |           |         |           |                      |
| <b>KANADA</b>   |           |         |                  |                      | <b>KANADA</b>   |           |         |           |                      |
| CNOOC FINANCE 4,875 %<br>30.04.2044                               | 1.309.000 | USD     | 1.275.448        | 0,36                 | GREENTOWN CHINA<br>HOLDINGS 5,65 % 13.07.2025                     | 250.000   | USD     | 231.183   | 0,06                 |
| NEXEN 7,5 % 30.07.2039  | 1.407.000 | USD     | 1.747.130        | 0,48                 | HENGJIAN INTERNATIONAL INVESTMENT 1,875 % 23.06.2025              | 821.000   | USD     | 784.426   | 0,22                 |
|   |           |         | <b>3.022.578</b> | <b>0,84</b>          | HUARONG FINANCE 5,5 %<br>16.01.2025                               | 750.000   | USD     | 742.399   | 0,21                 |
| <b>CHINA</b>  |           |         |                  |                      | <b>CHINA</b>  |           |         |           |                      |
| ALIBABA GROUP HOLDING<br>4,2 % 06.12.2047                         | 3.443.000 | USD     | 2.841.238        | 0,79                 | HUARONG FINANCE II<br>4,875 % 22.11.2026                          | 2.652.000 | USD     | 2.544.329 | 0,71                 |
| BAIDU 3,425 % 07.04.2030  | 350.000   | USD     | 319.355          | 0,09                 | HUARONG FINANCE II 5 %<br>19.11.2025                              | 300.000   | USD     | 292.573   | 0,08                 |
| BAIDU 4,125 % 30.06.2025  | 2.000.000 | USD     | 1.966.662        | 0,55                 | INDUSTRIAL AND COMMERCIAL BANK<br>OF CHINA 4,875 % 21.09.2025     | 3.500.000 | USD     | 3.474.968 | 0,97                 |
| BAIDU 4,375 % 14.05.2024  | 2.200.000 | USD     | 2.196.085        | 0,61                 | INVENTIVE GLOBAL INVESTMENTS<br>1,65 % 03.09.2025                 | 1.300.000 | USD     | 1.229.801 | 0,34                 |
| BANK OF CHINA 5 %<br>13.11.2024                                   | 6.500.000 | USD     | 6.476.546        | 1,81                 | JDCOM 3,375 % 14.01.2030  | 360.000   | USD     | 328.542   | 0,09                 |
| CHALCO HONG KONG<br>INVESTMENT 2,1 % 28.07.2026                   | 691.000   | USD     | 641.967          | 0,18                 | JDCOM 4,125 % 14.01.2050  | 320.000   | USD     | 253.531   | 0,07                 |
| CHINA CONSTRUCTION BANK<br>CORP 2,45 % VRN 24.06.2030             | 3.050.000 | USD     | 2.944.276        | 0,82                 | LONGFOR GROUP HOLDINGS<br>3,375 % 13.04.2027                      | 200.000   | USD     | 127.607   | 0,04                 |
| CHINA MENGNIU DAIRY<br>1,875 % 17.06.2025                         | 1.900.000 | USD     | 1.818.569        | 0,51                 | LONGFOR GROUP HOLDINGS<br>3,95 % 16.09.2029                       | 400.000   | USD     | 210.733   | 0,06                 |
| CHINA MODERN DAIRY<br>HOLDINGS 2,125 % 14.07.2026                 | 2.843.000 | USD     | 2.580.010        | 0,72                 | LONGFOR PROPERTIES 4,5 %<br>16.01.2028                            | 400.000   | USD     | 246.314   | 0,07                 |
| CHINA OVERSEAS FINANCE<br>5,95 % 08.05.2024                       | 1.916.000 | USD     | 1.915.590        | 0,53                 | REDCO PROPERTIES GROUP<br>7,3 % 21.05.2024                        | 299.000   | USD     | 3.891     | 0,00                 |
| CHINALCO CAPITAL<br>HOLDINGS 4,1 % VRN PERP                       | 2.350.000 | USD     | 2.332.775        | 0,65                 | RONGSHI INTERNATIONAL<br>FINANCE 3,75 % 21.05.2029                | 1.200.000 | USD     | 1.144.662 | 0,32                 |
| CICC HONG KONG FINANCE<br>2 % 26.01.2026                          | 1.804.000 | USD     | 1.703.262        | 0,47                 | SANDS CHINA 3,75 %<br>08/08/2031                                  | 327.000   | USD     | 274.062   | 0,08                 |
| CNOOC FINANCE 5,75 %<br>26.01.2041                                | 400.000   | USD     | 430.232          | 0,12                 | SF HOLDING INVESTMENT<br>2,875 % 20.02.2030                       | 4.300.000 | USD     | 3.813.160 | 1,06                 |
| CONTEMPORARY RUIDING DEVELOPMENT 1,5 % 09.09.2026                 | 800.000   | USD     | 729.839          | 0,20                 | SHENZHEN EXPRESSWAY<br>1,75 % 08.07.2026                          | 200.000   | USD     | 184.148   | 0,05                 |
| CONTEMPORARY RUIDING DEVELOPMENT 1,875 % 17.09.2025               | 200.000   | USD     | 189.904          | 0,05                 | SHOUGANG GROUP 4 %<br>23.05.2024                                  | 1.200.000 | USD     | 1.196.226 | 0,33                 |
| ENN CLEAN ENERGY INTERNATIONAL<br>3,375 % 12.05.2026              | 2.162.000 | USD     | 2.048.982        | 0,57                 | SINOPEC GROUP OVERSEAS DEVELOPMENT 2,7 % 13.05.2030               | 1.500.000 | USD     | 1.349.176 | 0,38                 |
| FUQING INVESTMENT MANAGEMENT<br>3,25 % 23.06.2025                 | 390.000   | USD     | 353.762          | 0,10                 | SINOPEC GROUP OVERSEAS DEVELOPMENT 2,95 % 12.11.2029              | 2.750.000 | USD     | 2.526.325 | 0,70                 |
| GEELY AUTOMOBILE<br>HOLDINGS 4 % VRN PERP                         | 1.549.000 | USD     | 1.526.444        | 0,43                 | SINOPEC GROUP OVERSEAS DEVELOPMENT 3,68 % 08.08.2049              | 600.000   | USD     | 483.724   | 0,13                 |
|   |           |         |                  |                      | SINOPEC GROUP OVERSEAS DEVELOPMENT 4,6 % 12.09.2048               | 600.000   | USD     | 560.551   | 0,16                 |
|   |           |         |                  |                      | SINOPEC GROUP OVERSEAS DEVELOPMENT 5,375 % 17.10.2043             | 300.000   | USD     | 311.098   | 0,09                 |
|   |           |         |                  |                      | TENCENT HOLDINGS 3,8 %<br>11/02/2025                              | 4.430.000 | USD     | 4.368.315 | 1,22                 |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Asia Bond (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung   | Nennwert  | Währung | Kurswert          | % des Nettovermögens | Beschreibung   | Nennwert  | Währung | Kurswert  | % des Nettovermögens |
|--|-----------|---------|-------------------|----------------------|--|-----------|---------|-----------|----------------------|
| TENCENT HOLDINGS 3,925 %<br>19.01.2038                 | 500.000   | USD     | 430.640           | 0,12                 | CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE<br>FINANCE 4 % PERP           | 800.000   | USD     | 534.528   | 0,15                 |
| TENCENT HOLDINGS 3,94 %<br>22.04.2061                  | 505.000   | USD     | 376.478           | 0,10                 | CHINA CHINDA FINANCE<br>5,625 % 14.05.2024               | 1.700.000 | USD     | 1.699.200 | 0,47                 |
| TENCENT MUSIC ENTERTAINMENT<br>2,00 % 03.09.2030       | 3.489.000 | USD     | 2.866.715         | 0,80                 | CHINA CLEAN ENERGY DEVE-<br>LOPMENT 4 % 05.11.2025       | 300.000   | USD     | 293.293   | 0,08                 |
| TINGYI 1,625 % 24.09.2025                              | 1.725.000 | USD     | 1.627.239         | 0,45                 | CHINA OVERSEA FINANCE<br>6,375 % 29.10.2043              | 237.000   | USD     | 230.355   | 0,06                 |
| WENS FOODSTUFFS GROUP<br>2,349 % 29.10.2025            | 850.000   | USD     | 773.851           | 0,22                 | CHINA OVERSEAS GRAND OCEANS<br>FINANCE 2,45 % 09.02.2026 | 251.000   | USD     | 220.549   | 0,06                 |
| WEST CHINA CEMENT 4,95 %<br>08/07/2026                 | 440.000   | USD     | 371.069           | 0,10                 | CHINA RESOURCES LAND<br>4,125 % 26.02.2029               | 200.000   | USD     | 187.323   | 0,05                 |
| WYNN MACAU 5,5 %<br>01/10/2027                         | 230.000   | USD     | 220.290           | 0,06                 | CLP POWER HONG KONG<br>FINANCING                         | 1.478.000 | USD     | 1.258.098 | 0,35                 |
| YONGDA INVESTMENT 2,25 %<br>16.06.2025                 | 1.600.000 | USD     | 1.535.671         | 0,43                 | 2,125 % 30.06.2030<br>CMB INTERNATIONAL LEASING<br>MANA- | 281.000   | USD     | 267.472   | 0,07                 |
| YUNDA HOLDING INVESTMENT<br>2,25 % 19.08.2025          | 2.960.000 | USD     | 2.802.038         | 0,78                 | GEMENT 1,875 % 12.08.2025<br>CNAC HK FINBRIDGE           | 2.509.000 | USD     | 2.423.330 | 0,68                 |
| ZHONGSHENG GROUP<br>HOLDINGS 3 % 13.01.2026            | 4.464.000 | USD     | 4.185.267         | 1,17                 | 4,125 % 19.07.2027<br>CNAC HK FINBRIDGE                  | 250.000   | USD     | 248.241   | 0,07                 |
|  |           |         | <b>74.886.500</b> | <b>20,87</b>         | 4,875 % 14.03.2025<br>CNAC HK FINBRIDGE                  | 2.499.000 | USD     | 2.497.211 | 0,70                 |
| <b>GROSSBRITANNIEN</b>                                 |           |         |                   |                      | 5,125 % 14.03.2028<br>ELECT GLOBAL INVESTMENTS           | 1.010.000 | USD     | 921.659   | 0,26                 |
| PRUDENTIAL 2,95 % VRN<br>03/11/2033                    | 1.128.000 | USD     | 1.003.621         | 0,28                 | 4,10 % VRN PERP<br>FORTUNE STAR 5 %                      | 1.000.000 | USD     | 862.463   | 0,24                 |
| VEDANTA RESOURCES<br>FINANCE 9,25 % 23.04.2026         | 200.000   | USD     | 163.501           | 0,05                 | 18.05.2026<br>FRANSHION BRILLIANT                        | 300.000   | USD     | 264.532   | 0,07                 |
| VEDANTA RESOURCES<br>FINANCE 13,875 % 21.01.2027       | 277.000   | USD     | 123.016           | 0,03                 | 3,2 % 09.04.2026<br>GLP CHINA HOLDINGS                   | 350.000   | USD     | 283.232   | 0,08                 |
|  |           |         | <b>1.290.138</b>  | <b>0,36</b>          | 2,95 % 29.03.2026<br>HKT CAPITAL 3 % 18.01.2032          | 2.023.000 | USD     | 1.751.168 | 0,49                 |
| <b>HONGKONG</b>  |           |         |                   |                      | HKT CAPITAL NO 4<br>3 % 14.07.2026                       | 1.100.000 | USD     | 1.045.315 | 0,29                 |
| AIA GROUP 2,7 % VRN PERP<br>AIA GROUP 3,2 % 16.09.2040 | 2.391.000 | USD     | 2.233.529         | 0,62                 | HONG KONG (GOVT) 4 %<br>07/06/2033                       | 6.125.000 | USD     | 5.981.408 | 1,67                 |
| AIRPORT AUTHORITY 2,1 %<br>VRN PERP                    | 1.900.000 | USD     | 1.425.253         | 0,40                 | HONGKONG ELECTRIC<br>FINANCE 2,25 % 09.06.2030           | 1.588.000 | USD     | 1.367.807 | 0,38                 |
| ANHUI TRANSPORTATION<br>HOLDING 1,618 % 26.08.2026     | 4.800.000 | USD     | 4.520.196         | 1,27                 | HONGKONG LAND FINANCE<br>4,5 % 07.10.2025                | 1.000.000 | USD     | 986.295   | 0,27                 |
| BANK OF EAST ASIA<br>4 % VRN 29.05.2030                | 3.649.000 | USD     | 3.335.480         | 0,93                 | HOPSON DEVELOPMENT<br>HOLDINGS 7 % 18.05.2024            | 200.000   | USD     | 193.509   | 0,05                 |
| BANK OF EAST ASIA<br>4,875 % VRN 22.04.2032            | 420.000   | USD     | 407.135           | 0,11                 | HUARONG FINANCE 2017<br>4,75 % 27.04.2027                | 300.000   | USD     | 284.906   | 0,08                 |
| BANK OF EAST ASIA<br>6,625 % VRN 13.03.2027            | 250.000   | USD     | 235.052           | 0,07                 | HUARONG FINANCE 3,375 %<br>24.02.2030                    | 200.000   | USD     | 171.638   | 0,05                 |
| BLOSSOM JOY 2,2 %<br>21.10.2030                        | 883.000   | USD     | 890.979           | 0,25                 | HUARONG FINANCE 3,75 %<br>29.05.2024                     | 1.000.000 | USD     | 994.919   | 0,28                 |
| CAS CAPITAL 4 % VRN PERP<br>CASTLE PEAK POWER          | 400.000   | USD     | 366.475           | 0,10                 | HUARONG FINANCE 4,25 %<br>07/11/2027                     | 400.000   | USD     | 369.881   | 0,10                 |
| FINANCE 2,2 % 22.06.2030<br>CHAMPION PATH HOLDINGS     | 884.000   | USD     | 756.732           | 0,21                 | HUARONG FINANCE 4,5 %<br>29.05.2029                      | 270.000   | USD     | 246.630   | 0,07                 |
| 4,5 % 27.01.2026<br>CHARMING LIGHT INVESTMENTS         | 200.000   | USD     | 190.690           | 0,05                 |  |           |         |           |                      |
| 4,375 % 21.12.2027                                     | 550.000   | USD     | 525.990           | 0,15                 |  |           |         |           |                      |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Asia Bond (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung  | Nennwert  | Währung | Kurswert  | % des Nettovermögens | Beschreibung   | Nennwert  | Währung | Kurswert          | % des Nettovermögens |
|---|-----------|---------|-----------|----------------------|--|-----------|---------|-------------------|----------------------|
| HUARONG FINANCE 4,625 %<br>03/06/2026                     | 500.000   | USD     | 480.470   | 0,13                 | XIAOMI BEST TIME INTERNATIONAL<br>3,375 % 29.04.2030 | 300.000   | USD     | 265.321           | 0,07                 |
| HYSAN MTN 2,875 %<br>02/06/2027                           | 494.000   | USD     | 453.569   | 0,13                 | XIAOMI BEST TIME INTERNATIONAL<br>4,1 % 14.07.2051   | 1.188.000 | USD     | 855.000           | 0,24                 |
| JOY TREASURE ASSETS<br>HOLDINGS 1,875 % 17.11.2025        | 708.000   | USD     | 664.969   | 0,19                 | YANGO JUSTICE INTERNATIONAL<br>8,25 % 25.11.2023*    | 200.000   | USD     | 1.307             | 0,00                 |
| KING POWER CAPITAL<br>5,625 % 03.11.2024                  | 1.700.000 | USD     | 1.699.032 | 0,47                 |  |           |         | <b>57.931.520</b> | <b>16,14</b>         |
| LAI SUN 5 % 28.07.2026                                    | 240.000   | USD     | 146.166   | 0,04                 | <b>INDIEN</b>  |           |         |                   |                      |
| LENOVO 3,421 % 02.11.2030                                 | 440.000   | USD     | 386.514   | 0,11                 | BHARTI AIRTEL 5,35 %<br>20.05.2024                   | 2.550.000 | USD     | 2.547.367         | 0,70                 |
| LENOVO GROUP 5,831 %<br>27.01.2028                        | 300.000   | USD     | 303.869   | 0,08                 | DELHI INTERNATIONAL<br>AIRPORT 6,125 % 31.10.2026    | 200.000   | USD     | 198.413           | 0,06                 |
| LENOVO GROUP 6,536 %<br>27.07.2032                        | 1.800.000 | USD     | 1.901.885 | 0,53                 | DELHI INTERNATIONAL<br>AIRPORT 6,45 % 04.06.2029     | 350.000   | USD     | 345.824           | 0,10                 |
| LINK FINANCE 2,75 %<br>19.01.2032                         | 1.100.000 | USD     | 933.855   | 0,26                 | EXPORT IMPORT BANK OF<br>INDIA 2,25 % 13.01.2031     | 3.051.000 | USD     | 2.525.533         | 0,70                 |
| LS FINANCE 4,5 %<br>26.06.2025                            | 200.000   | USD     | 188.701   | 0,05                 | GMR HYDERABAD INTERNATIONAL<br>4,75 % 02.02.2026     | 250.000   | USD     | 242.736           | 0,07                 |
| LS FINANCE 4,8 %<br>18.06.2026                            | 200.000   | USD     | 176.747   | 0,05                 | HPCL MITTAL ENERGY<br>5,25 % 28.04.2027              | 400.000   | USD     | 386.199           | 0,11                 |
| MELCO RESORTS FINANCE<br>4,875 % 06.06.2025               | 780.000   | USD     | 761.954   | 0,21                 | HPCL MITTAL ENERGY 5,45 %<br>22.10.2026              | 764.000   | USD     | 744.500           | 0,21                 |
| MELCO RESORTS FINANCE<br>5,25 % 26.04.2026                | 300.000   | USD     | 289.481   | 0,08                 | ICICI BANK DUBAI 4 %<br>18.03.2026                   | 700.000   | USD     | 682.180           | 0,19                 |
| NAN FUNG TREASURY<br>3,625 % 27.08.2030                   | 1.004.000 | USD     | 872.553   | 0,24                 | INDIABULLS HOUSING<br>FINANCE 9,7 % 03.07.2027       | 200.000   | USD     | 200.074           | 0,06                 |
| NAN FUNG TREASURY<br>3,875 % 03.10.2027                   | 220.000   | USD     | 203.639   | 0,06                 | JSW INFRASTRUCTURE<br>4,95 % 21.01.2029              | 1.319.000 | USD     | 1.240.781         | 0,35                 |
| NWD FINANCE 6,15 % VRN<br>PERP                            | 1.667.000 | USD     | 1.470.429 | 0,41                 | JSW STEEL 5,95 %<br>18.04.2024                       | 324.000   | USD     | 323.768           | 0,09                 |
| NWD FINANCE 6,25 % PERP                                   | 200.000   | USD     | 110.685   | 0,03                 | NTPC 4,375 % 26.11.2024                              | 900.000   | USD     | 891.151           | 0,25                 |
| NWD MTN 4,125 % 18.07.2029                                | 330.000   | USD     | 253.464   | 0,07                 | POWER FINANCE 3,35 %<br>16.05.2031                   | 400.000   | USD     | 348.268           | 0,10                 |
| NWD MTN 4,5 % 19.05.2030                                  | 240.000   | USD     | 181.436   | 0,05                 | POWER FINANCE 3,9 %<br>16.09.2029                    | 1.800.000 | USD     | 1.665.493         | 0,46                 |
| PINGAN REAL ESTATE<br>CAPITAL 3,45 % 29.07.2026           | 200.000   | USD     | 166.843   | 0,05                 | POWER FINANCE 3,95 %<br>23.04.2030                   | 1.939.000 | USD     | 1.777.742         | 0,50                 |
| RKPF OVERSEAS 6,7 %<br>30.09.2024                         | 250.000   | USD     | 155.720   | 0,04                 | POWER FINANCE 4,5 %<br>18.06.2029                    | 350.000   | USD     | 335.570           | 0,09                 |
| SHANGHAI PORT GROUP BVI DEVE-<br>LOPMENT 1,5 % 13.07.2025 | 600.000   | USD     | 571.421   | 0,16                 | REC 2,75 % 13.01.2027                                | 3.245.000 | USD     | 3.010.755         | 0,83                 |
| SHUI ON DEVELOPMENT<br>HOLDING 6,15 % 24.08.2024          | 200.000   | USD     | 176.348   | 0,05                 | REC 3,375 % 25.07.2024                               | 1.100.000 | USD     | 1.091.045         | 0,30                 |
| STUDIO CITY FINANCE 5 %<br>15.01.2029                     | 200.000   | USD     | 176.289   | 0,05                 | RELIANCE INDUSTRIES<br>3,75 % 12.01.2062             | 400.000   | USD     | 285.755           | 0,08                 |
| SUNNY EXPRESS ENTERPRISES<br>2,625 % 23.04.2025           | 400.000   | USD     | 388.309   | 0,11                 | RENEW POWER 5,875 %<br>05/03/2027                    | 330.000   | USD     | 322.580           | 0,09                 |
| TCCL FINANCE 4 %<br>26.04.2027                            | 1.400.000 | USD     | 1.335.612 | 0,37                 | RENEW WIND ENERGY 4,5 %<br>14.07.2028                | 200.000   | USD     | 183.047           | 0,05                 |
| XIAOMI BEST TIME INTERNATIONAL<br>2,875 % 14.07.2031      | 804.000   | USD     | 670.363   | 0,19                 |  |           |         | <b>19.348.781</b> | <b>5,39</b>          |

\* Der Vermögenswert, der am 25. November 2023 fällig war, ist notleidend, Zur Bewertung wurde der letzte verfügbare Preis auf dem Markt herangezogen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



## Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Asia Bond (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung  | Nennwert  | Währung | Kurswert          | % des Nettovermögens | Beschreibung                                     | Nennwert  | Währung | Kurswert         | % des Nettovermögens |
|---|-----------|---------|-------------------|----------------------|--|-----------|---------|------------------|----------------------|
| <b>INDONESIEN</b>                                   |           |         |                   |                      | <b>IRLAND</b>                                    |           |         |                  |                      |
| ADARO INDONESIA 4,25 %<br>31.10.2024                | 1.836.000 | USD     | 1.811.732         | 0,51                 | AVOLON HOLDINGS FUNDING<br>5,75 % 01.03.2029     | 740.000   | USD     | 738.155          | 0,21                 |
| BANK MANDIRI PERSERO 2 %<br>19.04.2026              | 857.000   | USD     | 800.413           | 0,22                 | CCBL CAYMAN 1,99 %<br>21.07.2025                 | 1.500.000 | USD     | 1.433.784        | 0,40                 |
| HYUNDAI MOTOR MANUFACTURING<br>1,75 % 06.05.2026    | 200.000   | USD     | 185.058           | 0,05                 |  |           |         | <b>2.171.939</b> | <b>0,61</b>          |
| INDOFOOD CBP SUKSES<br>MAKMUR 3,541 % 27.04.2032    | 1.000.000 | USD     | 864.650           | 0,24                 | <b>JAPAN</b>                                     |           |         |                  |                      |
| INDONESIA (GOVT) 3,05 %<br>12/03/2051               | 3.000.000 | USD     | 2.129.937         | 0,59                 | FUKOKU MUTUAL LIFE<br>INSURANCE 6,8 % VRN PERP   | 1.364.000 | USD     | 1.438.723        | 0,41                 |
| INDONESIA (GOVT) 3,2 %<br>23.09.2061                | 2.690.000 | USD     | 1.792.259         | 0,50                 | MITSUBISHI UFJ<br>FINANCIAL 8,2 % VRN PERP       | 200.000   | USD     | 216.142          | 0,06                 |
| INDONESIA (GOVT) 3,70 %<br>30.10.2049               | 2.738.000 | USD     | 2.142.099         | 0,60                 | MIZUHO FINANCIAL 5,579 %<br>26.05.2035           | 618.000   | USD     | 626.518          | 0,17                 |
| INDONESIA (GOVT) 4,2 %<br>15.10.2050                | 5.564.000 | USD     | 4.705.851         | 1,31                 | RAKUTEN GROUP 11,25 %<br>15.02.2027              | 340.000   | USD     | 360.457          | 0,10                 |
| INDONESIA (GOVT) 4,4 %<br>10/03/2029                | 1.161.000 | USD     | 1.136.852         | 0,32                 | SUMITOMO LIFE INSURANCE<br>5,875 % VRN PERP      | 931.000   | USD     | 928.603          | 0,26                 |
| INDONESIA (GOVT) 4,7 %<br>10/02/2034                | 710.000   | USD     | 693.558           | 0,19                 |  |           |         | <b>3.570.443</b> | <b>1,00</b>          |
| INDONESIA (GOVT) 5,1 %<br>10/02/2054                | 3.560.000 | USD     | 3.451.836         | 0,96                 | <b>MACAU</b>                                     |           |         |                  |                      |
| INDONESIA ASAHAN<br>ALUMINIUM 5,45 % 15.05.2030     | 1.800.000 | USD     | 1.780.465         | 0,50                 | MGM CHINA HOLDINGS<br>4,75 % 01.02.2027          | 200.000   | USD     | 190.811          | 0,05                 |
| INDONESIA ASAHAN<br>ALUMINIUM 5,8 % 15.05.2050      | 430.000   | USD     | 407.616           | 0,11                 |  |           |         | <b>190.811</b>   | <b>0,05</b>          |
| JAPFA COMFEED INDONESIA<br>5,375 % 23.03.2026       | 200.000   | USD     | 184.546           | 0,05                 | <b>MAURITIUS</b>                                 |           |         |                  |                      |
| PAKUWON JATI 4,875 %<br>29.04.2028                  | 1.530.000 | USD     | 1.434.194         | 0,40                 | DIAMOND 7,95 % 28.07.2026                        | 250.000   | USD     | 254.502          | 0,08                 |
| PELABUHAN INDONESIA II<br>4,25 % 05.05.2025         | 800.000   | USD     | 789.502           | 0,22                 | GREENKO SOLAR MAURITIUS<br>5,95 % 29.07.2026     | 200.000   | USD     | 195.197          | 0,05                 |
| PERTAMINA 5,625 %<br>20.05.2043                     | 300.000   | USD     | 294.888           | 0,08                 | INDIA AIRPORT INFRA<br>6,25 % 25.10.2025         | 250.000   | USD     | 250.278          | 0,07                 |
| PERTAMINA PERSERO 3,1 %<br>21.01.2030               | 1.000.000 | USD     | 896.605           | 0,25                 | NETWORK 3,975 % VRN PERP                         | 200.000   | USD     | 190.253          | 0,05                 |
| PERTAMINA PERSERO 4,15 %<br>25.02.2060              | 4.111.000 | USD     | 3.139.550         | 0,88                 |  |           |         | <b>890.230</b>   | <b>0,25</b>          |
| PERTAMINA PERSERO 4,175 %<br>21.01.2050             | 850.000   | USD     | 678.536           | 0,19                 | <b>MONGOLEI</b>                                  |           |         |                  |                      |
| PERUSAHAAN LISTRIK<br>NEGARA 3,375 % 05.02.2030     | 3.500.000 | USD     | 3.149.603         | 0,88                 | MONGOLIA (GOVT) 3,5 %<br>07/07/2027              | 270.000   | USD     | 243.490          | 0,07                 |
| PERUSAHAAN LISTRIK<br>NEGARA 4,375 % 05.02.2050     | 450.000   | USD     | 359.973           | 0,10                 | MONGOLIA (GOVT) 4,45 %<br>07/07/2031             | 248.000   | USD     | 210.883          | 0,06                 |
| PERUSAHAAN PERSEROAN<br>PERSERO 4 % 30.06.2050      | 700.000   | USD     | 521.780           | 0,15                 | MONGOLIA (GOVT) 7,875 %<br>05/06/2029            | 200.000   | USD     | 207.029          | 0,06                 |
| STAR ENERGY GEOTHERMAL<br>DARAJAT 4,85 % 14.10.2038 | 780.000   | USD     | 723.734           | 0,20                 | MONGOLIA (GOVT) 8,65 %<br>19.01.2028             | 350.000   | USD     | 369.662          | 0,10                 |
|   |           |         | <b>34.075.237</b> | <b>9,50</b>          | MONGOLIAN MINING CORPENERGY<br>12,5 % 13.09.2026 | 180.000   | USD     | 194.350          | 0,05                 |
|   |           |         |                   |                      |  |           |         | <b>1.225.414</b> | <b>0,34</b>          |
|   |           |         |                   |                      | <b>NIEDERLANDE</b>                               |           |         |                  |                      |
|   |           |         |                   |                      | MINEJESA CAPITAL 4,625 %<br>10/08/2030           | 450.000   | USD     | 397.419          | 0,11                 |
|   |           |         |                   |                      | MINEJESA CAPITAL 5,625 %<br>10/08/2037           | 477.000   | USD     | 432.748          | 0,12                 |
|   |           |         |                   |                      | ROYAL CAPITAL 5 % VRN<br>PERP                    | 1.700.000 | USD     | 1.676.466        | 0,47                 |
|   |           |         |                   |                      |  |           |         | <b>2.506.633</b> | <b>0,70</b>          |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Asia Bond (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung   | Nennwert  | Währung | Kurswert  | % des Nettovermögens | Beschreibung                                     | Nennwert  | Währung | Kurswert  | % des Nettovermögens |
|--|-----------|---------|-----------|----------------------|--|-----------|---------|-----------|----------------------|
| <b>PAKISTAN</b>  |           |         |           |                      | KB KOOKMIN CARD 1,5 %<br>13.05.2026              | 550.000   | USD     | 506.439   | 0,14                 |
| PAKISTAN (GOVT) 6 %<br>08/04/2026                            | 1.620.000 | USD     | 1.453.076 | 0,41                 | KODIT GLOBAL 3,619 %<br>27.05.2025               | 2.357.000 | USD     | 2.309.289 | 0,63                 |
| <b>PHILIPPINEN</b>   |           |         |           |                      | KOOKMIN BANK 2,5 %<br>04/11/2030                 | 723.000   | USD     | 602.419   | 0,17                 |
| DEVELOPMENT BANK OF THE<br>PHILLIPINES 2,375 %<br>11/03/2031 | 1.433.000 | USD     | 1.195.309 | 0,33                 | KOOKMIN BANK 4,35 % VRN<br>PERP                  | 800.000   | USD     | 795.140   | 0,22                 |
| METROPOLITAN BANK<br>5,375 % 06.03.2029                      | 1.694.000 | USD     | 1.698.140 | 0,48                 | KOOKMIN BANK 4,5 %<br>01/02/2029                 | 707.000   | USD     | 677.124   | 0,19                 |
|  |           |         |           |                      | KOREA EXCHANGE BANK<br>4,25 % 14.10.2024         | 1.900.000 | USD     | 1.883.473 | 0,53                 |
|  |           |         |           |                      | KOREA NATIONAL OIL<br>2,125 % 18.04.2027         | 2.054.000 | USD     | 1.885.653 | 0,53                 |
| <b>SINGAPUR</b>  |           |         |           |                      | KT CORP 2,5 % 18.07.2026                         | 600.000   | USD     | 564.521   | 0,16                 |
| ABJA INVESTMENT 5,45 %<br>24.01.2028                         | 540.000   | USD     | 539.397   | 0,15                 | LG ENERGY SOLUTION<br>5,75 % 25.09.2028          | 1.021.000 | USD     | 1.037.016 | 0,29                 |
| BOC AVIATION 3,25 %<br>29.04.2025                            | 1.100.000 | USD     | 1.072.512 | 0,30                 | POSCO 4,875 % 23.01.2027                         | 1.565.000 | USD     | 1.546.315 | 0,43                 |
| BOC AVIATION 3,5 %<br>10/10/2024                             | 1.000.000 | USD     | 988.437   | 0,28                 | SHINHAN BANK 3,875 %<br>24.03.2026               | 200.000   | USD     | 193.412   | 0,05                 |
| CONTINUUM ENERGY AURA<br>9,5 % 24.02.2027                    | 200.000   | USD     | 208.079   | 0,06                 | SHINHAN BANK 4 %<br>23.04.2029                   | 811.000   | USD     | 757.245   | 0,21                 |
| DBS GROUP HOLDINGS 3,3 %<br>VRN PERP                         | 1.706.000 | USD     | 1.664.619 | 0,46                 | SHINHAN BANK 4,375 %<br>13.04.2032               | 802.000   | USD     | 743.990   | 0,21                 |
| GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES<br>3,875 % 04.06.2025             | 795.000   | USD     | 702.643   | 0,20                 | SHINHAN CARD 2,5 %<br>27.01.2027                 | 1.920.000 | USD     | 1.773.517 | 0,49                 |
| HPHT FINANCE 1,5 %<br>17.09.2026                             | 3.426.000 | USD     | 3.125.257 | 0,86                 | SHINHAN FINANCIAL GROUP<br>3,34 % VRN 05.02.2030 | 2.100.000 | USD     | 2.053.182 | 0,57                 |
| INDIKA ENERGY CAPITAL<br>8,25 % 22.10.2025                   | 450.000   | USD     | 453.781   | 0,13                 | SK HYNIX 5,5 % 16.01.2027                        | 1.105.000 | USD     | 1.105.741 | 0,31                 |
| INDIKA ENERGY CAPITAL<br>III PTE 5,875 % 09.11.2024          | 1.950.000 | USD     | 1.945.010 | 0,54                 | SK HYNIX 5,5 % 16.01.2029                        | 1.864.000 | USD     | 1.861.751 | 0,52                 |
| LLPL CAPITAL 6,875 %<br>04/02/2039                           | 2.350.000 | USD     | 1.812.853 | 0,51                 | SK HYNIX 6,5 % 17.01.2033                        | 700.000   | USD     | 748.196   | 0,21                 |
| MEDCO MAPLE TREE 8,96 %<br>27.04.2029                        | 450.000   | USD     | 468.867   | 0,13                 | WOORI BANK 4,25 % VRN<br>PERP                    | 600.000   | USD     | 592.131   | 0,17                 |
| MEDCO OAK TREE 7,375 %<br>14.05.2026                         | 1.190.000 | USD     | 1.192.639 | 0,33                 | WOORI BANK 4,75 %<br>30.04.2024                  | 1.300.000 | USD     | 1.298.630 | 0,36                 |
| ONGC VIDESH VANKORNEFT<br>3,75 % 27.07.2026                  | 2.000.000 | USD     | 1.926.932 | 0,54                 | WOORI BANK 5,125 %<br>06/08/2028                 | 1.200.000 | USD     | 1.180.638 | 0,33                 |
| OVERSEA CHINESE BANKING<br>4,25 % 19.06.2024                 | 1.000.000 | USD     | 996.546   | 0,28                 | <b>SRI LANKA</b>                                 |           |         |           |                      |
| OVERSEACHINESE BANKING<br>1,832 % VRN 10.09.2030             | 668.000   | USD     | 632.016   | 0,18                 | SRI LANKA (GOVT) 6,2 %<br>11/05/2027             | 350.000   | USD     | 207.282   | 0,05                 |
| TML HOLDINGS 4,35 %<br>09/06/2026                            | 377.000   | USD     | 362.686   | 0,10                 | SRI LANKA (GOVT) 6,85 %<br>03/11/2025            | 330.000   | USD     | 198.436   | 0,06                 |
| UNITED OVERSEAS BANK<br>1,75 % VRN 16.03.2031                | 2.491.000 | USD     | 2.315.325 | 0,64                 | SRI LANKA (GOVT) 7,55 %<br>28.03.2030            | 350.000   | USD     | 206.471   | 0,06                 |
|  |           |         |           |                      | <b>THAILAND</b>                                  |           |         |           |                      |
|  |           |         |           |                      | BANGKOK BANK 3,466 % VRN<br>23.09.2036           | 1.040.000 | USD     | 878.695   | 0,24                 |
|  |           |         |           |                      | BANGKOK BANK 3,733 % VRN<br>25.09.2034           | 700.000   | USD     | 624.589   | 0,17                 |
|  |           |         |           |                      | <b>24.681.106 6,88</b>                           |           |         |           |                      |
|  |           |         |           |                      | <b>612.189 0,17</b>                              |           |         |           |                      |
| <b>SÜDKOREA</b>  |           |         |           |                      |  |           |         |           |                      |
| GS CALTEX 5,375 %<br>07/08/2028                              | 563.000   | USD     | 565.284   | 0,16                 |  |           |         |           |                      |
|  |           |         |           |                      | <b>20.407.599 5,69</b>                           |           |         |           |                      |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Asia Bond (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung   | Nennwert  | Währung | Kurswert           | % des Nettovermögens | Beschreibung   | Nennwert  | Währung | Kurswert          | % des Nettovermögens |
|--|-----------|---------|--------------------|----------------------|--|-----------|---------|-------------------|----------------------|
| BANGKOK BANK 5 % VRN PERP  | 200.000   | USD     | 194.843            | 0,05                 | <b>CHINA</b>   |           |         |                   |                      |
| EXPORT IMPORT BANK OF THAILAND 3,902 % 02.06.2027                            | 1.272.000 | USD     | 1.224.708          | 0,34                 | ALIBABA GROUP HOLDING 4,5 % 28.11.2034               | 2.300.000 | USD     | 2.179.341         | 0,61                 |
| GC TREASURY CENTER 4,3 % 18.03.2051  | 270.000   | USD     | 205.652            | 0,06                 | CHINA CINDA FINANCE 4,25 % 23.04.2025                | 3.150.000 | USD     | 3.102.488         | 0,87                 |
| KASIKORN BANK 3,343 % VRN 02/10/2031   | 200.000   | USD     | 186.111            | 0,05                 | MEITUAN DIANPING 3,05 % 28.10.2030                   | 1.130.000 | USD     | 969.872           | 0,27                 |
| KRUNG THAI BANK 4,4 % VRN PERP   | 941.000   | USD     | 894.805            | 0,25                 | SANDS CHINA 3,8 % 08/01/2026                         | 800.000   | USD     | 769.672           | 0,21                 |
| MINOR INTERNATIONAL 2,7 % VRN PERP   | 1.925.000 | USD     | 1.807.339          | 0,51                 | SANDS CHINA 4,375 % 18.06.2030                       | 400.000   | USD     | 366.965           | 0,10                 |
| THAIOIL TREASURY CENTER 3,75 % 18.06.2050                                    | 2.125.000 | USD     | 1.522.442          | 0,43                 | SINOPEC GROUP OVERSEAS DEVELOPMENT 4,25 % 03.05.2046 | 1.200.000 | USD     | 1.071.185         | 0,30                 |
|  |           |         | <b>7.539.184</b>   | <b>2,10</b>          | SINOPEC GROUP OVERSEAS DEVELOPMENT 4,25 % 12.04.2047 | 400.000   | USD     | 356.682           | 0,10                 |
| <b>TÜRKEI</b>  |           |         |                    |                      | TENCENT HOLDINGS 2,39 % 03/06/2030                   | 1.200.000 | USD     | 1.026.214         | 0,29                 |
| HYUNDAI ASSAN OTOMOTIV SANAYI 1,625 % 12.07.2026                             | 850.000   | USD     | 776.791            | 0,22                 | TENCENT HOLDINGS 3,24 % 03/06/2050                   | 1.100.000 | USD     | 748.161           | 0,21                 |
|  |           |         | <b>776.791</b>     | <b>0,22</b>          | TENCENT HOLDINGS 3,595 % 19.01.2028                  | 2.000.000 | USD     | 1.901.063         | 0,53                 |
| <b>USA</b>   |           |         |                    |                      | TENCENT HOLDINGS 3,975 % 11/04/2029                  | 1.600.000 | USD     | 1.521.815         | 0,42                 |
| BOC AVIATION 4,875 % 03/05/2033  | 247.000   | USD     | 242.616            | 0,07                 |  |           |         | <b>14.013.458</b> | <b>3,91</b>          |
| HYUNDAI CAPITAL AMERICA 5,3 % 08.01.2029                                     | 124.000   | USD     | 124.239            | 0,03                 | <b>GROSSBRITANNIEN</b>                               |           |         |                   |                      |
| PERIAMA HOLDINGS 5,95 % 19.04.2026   | 670.000   | USD     | 662.595            | 0,18                 | STANDARD CHARTERED 7,875 % VRN PERP                  | 5.223.000 | USD     | 5.215.740         | 1,45                 |
| RESORTS WORLD LAS VEGAS 8,45 % 27.07.2030                                    | 1.100.000 | USD     | 1.187.616          | 0,34                 |  |           |         | <b>5.215.740</b>  | <b>1,45</b>          |
| SASOL FINANCING 5,5 % 18.03.2031   | 200.000   | USD     | 168.985            | 0,05                 | <b>HONGKONG</b>                                      |           |         |                   |                      |
|  |           |         | <b>2.386.051</b>   | <b>0,67</b>          | AIA GROUP 5,375 % 05/04/2034                         | 1.862.000 | USD     | 1.864.424         | 0,51                 |
| <b>SUMME ANLEIHEN</b>  |           |         | <b>261.859.669</b> | <b>73,00</b>         | CK HUTCHISON INTERNATIONAL 3,375 % 08.05.2050        | 700.000   | USD     | 520.884           | 0,15                 |
| <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTEN WERTPAPIERE</b>              |           |         | <b>261.859.669</b> | <b>73,00</b>         | CMB INTERNATIONAL LEASING MANAGEMENT 3 % 03.07.2024  | 600.000   | USD     | 595.660           | 0,17                 |
| <b>AN EINEM ANDEREM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE, ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |           |         |                    |                      | NEW WORLD CHINA LAND 4,75 % 23.01.2027               | 250.000   | USD     | 222.204           | 0,06                 |
|  |           |         |                    |                      |  |           |         | <b>3.203.172</b>  | <b>0,89</b>          |
| <b>ANLEIHEN</b>  |           |         |                    |                      | <b>INDIEN</b>  |           |         |                   |                      |
| <b>AUSTRALIEN</b>  |           |         |                    |                      | ADANI GREEN ENERGY 6,7 % 12/03/2042                  | 1.146.000 | USD     | 1.110.993         | 0,31                 |
| AUSTRALIA NEW ZEALAND BANKING 2,95 % VRN 22.07.2030                          | 2.000.000 | USD     | 1.922.245          | 0,54                 | HDFC BANK 5,196 % 15.02.2027                         | 3.343.000 | USD     | 3.322.388         | 0,94                 |
| CIMIC FINANCE 7 % 25.03.2034   | 820.000   | USD     | 842.226            | 0,23                 | RELIANCE INDUSTRIES 3,625 % 12.01.2052               | 950.000   | USD     | 690.210           | 0,19                 |
|  |           |         | <b>2.764.471</b>   | <b>0,77</b>          | RELIANCE INDUSTRIES 3,667 % 30.11.2027               | 1.100.000 | USD     | 1.043.100         | 0,29                 |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Asia Bond (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung                                      | Nennwert  | Währung | Kurswert         | % des Nettovermögens | Beschreibung                                    | Nennwert  | Währung | Kurswert          | % des Nettovermögens |
|---|-----------|---------|------------------|----------------------|---|-----------|---------|-------------------|----------------------|
| RELIANCE INDUSTRIES<br>4,875 % 10.02.2045         | 1.100.000 | USD     | 1.008.114        | 0,28                 | <b>PAKISTAN</b>                                 |           |         |                   |                      |
| SHRIRAM FINANCE 6,625 %<br>22.04.2027             | 368.000   | USD     | 369.669          | 0,10                 | PAKISTAN (GOVT) 6,875 %<br>05/12/2027           | 600.000   | USD     | 514.290           | 0,14                 |
| SHRIRAM TRANSPORT<br>FINANCE 4,15 % 18.07.2025    | 200.000   | USD     | 193.903          | 0,05                 | PAKISTAN (GOVT) 8,25 %<br>30.09.2025            | 245.000   | USD     | 231.243           | 0,06                 |
|   |           |         | <b>7.738.377</b> | <b>2,16</b>          | PAKISTAN (GOVT) 8,875 %<br>08/04/2051           | 600.000   | USD     | 454.785           | 0,13                 |
| <b>INDONESIEN</b>                                 |           |         |                  |                      |   |           |         | <b>1.200.318</b>  | <b>0,33</b>          |
| FREEPORT INDONESIA 6,2 %<br>14.04.2052            | 1.460.000 | USD     | 1.454.612        | 0,41                 | <b>PHILIPPINEN</b>                              |           |         |                   |                      |
| INDONESIA (GOVT) 4,3 %<br>31.03.2052              | 1.300.000 | USD     | 1.117.436        | 0,31                 | PHILIPPINE (GOVT) 2,65 %<br>10/12/2045          | 833.000   | USD     | 551.895           | 0,15                 |
| INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM<br>6,757 % 15.11.2048  | 500.000   | USD     | 532.351          | 0,15                 | PHILIPPINE (GOVT) 2,95 %<br>05/05/2045          | 6.796.000 | USD     | 4.784.492         | 1,33                 |
| MAJAPAHIT HOLDING<br>7,875 % 29.06.2037           | 250.000   | USD     | 296.855          | 0,08                 | PHILIPPINES (GOVT) 3,2 %<br>06/07/2046          | 399.000   | USD     | 287.019           | 0,08                 |
| PERUSAHAAN LISTRIK<br>NEGARA 6,25 % 25.01.2049    | 1.330.000 | USD     | 1.358.882        | 0,38                 | PHILIPPINES (GOVT) 4,2 %<br>29.03.2047          | 6.700.000 | USD     | 5.667.134         | 1,59                 |
|   |           |         | <b>4.760.136</b> | <b>1,33</b>          |   |           |         | <b>11.290.540</b> | <b>3,15</b>          |
| <b>IRLAND</b>                                     |           |         |                  |                      | <b>SINGAPUR</b>                                 |           |         |                   |                      |
| SMBC AVIATION CAPITAL<br>FINANCE 5,7 % 25.07.2033 | 1.000.000 | USD     | 1.010.077        | 0,28                 | BOC AVIATION 3,5 %<br>18.09.2027                | 1.000.000 | USD     | 944.554           | 0,26                 |
|   |           |         | <b>1.010.077</b> | <b>0,28</b>          | TEMASEK FINANCIAL<br>2,375 % 02.08.2041         | 5.800.000 | USD     | 4.303.010         | 1,20                 |
| <b>MACAU</b>                                      |           |         |                  |                      |   |           |         | <b>5.247.564</b>  | <b>1,46</b>          |
| SANDS CHINA 3,35 %<br>08/03/2029                  | 400.000   | USD     | 347.961          | 0,10                 | <b>SÜDKOREA</b>                                 |           |         |                   |                      |
| SANDS CHINA 5,4 %<br>08/08/2028                   | 1.373.000 | USD     | 1.347.430        | 0,37                 | HANA BANK 3,25 %<br>30.03.2027                  | 2.868.000 | USD     | 2.725.397         | 0,77                 |
|   |           |         | <b>1.695.391</b> | <b>0,47</b>          | HANWHA LIFE INSURANCE<br>3,379 % VRN 04.02.2032 | 1.100.000 | USD     | 1.022.271         | 0,28                 |
| <b>MALAYSIA</b>                                   |           |         |                  |                      | HYUNDAI CAPITAL<br>SERVICES 5,125 % 05.02.2027  | 1.200.000 | USD     | 1.191.848         | 0,33                 |
| GOHL CAPITAL 4,25 %<br>24.01.2027                 | 3.738.000 | USD     | 3.597.188        | 1,01                 | KOREA GAS 3,875 %<br>13.07.2027                 | 229.000   | USD     | 221.004           | 0,06                 |
| PETRONAS CAPITAL 3,404 %<br>28.04.2061            | 2.139.000 | USD     | 1.476.636        | 0,41                 | KT 4 % 08.08.2025                               | 1.842.000 | USD     | 1.809.535         | 0,50                 |
| PETRONAS CAPITAL 4,55 %<br>21.04.2050             | 1.500.000 | USD     | 1.331.142        | 0,37                 | NONGHYUP BANK 4,25 %<br>06/07/2027              | 2.072.000 | USD     | 2.020.198         | 0,56                 |
| PETRONAS CAPITAL 4,8 %<br>21.04.2060              | 3.090.000 | USD     | 2.808.000        | 0,78                 | POSCO 4,375 % 04.08.2025                        | 2.045.000 | USD     | 2.013.587         | 0,56                 |
|   |           |         | <b>9.212.966</b> | <b>2,57</b>          | SHINHAN BANK 3,75 %<br>20.09.2027               | 900.000   | USD     | 851.459           | 0,24                 |
| <b>MAURITIUS</b>                                  |           |         |                  |                      |   |           |         | <b>11.855.299</b> | <b>3,30</b>          |
| NETWORK 5,65 % VRN PERP                           | 200.000   | USD     | 198.604          | 0,06                 | <b>TAIWAN</b>                                   |           |         |                   |                      |
|   |           |         | <b>198.604</b>   | <b>0,06</b>          | TSMC GLOBAL 1,25 %<br>23.04.2026                | 9.600.000 | USD     | 8.890.068         | 2,48                 |
| <b>MONGOLEI</b>                                   |           |         |                  |                      |   |           |         | <b>8.890.068</b>  | <b>2,48</b>          |
| MONGOLIA (GOVT) 5,125 %<br>07/04/2026             | 330.000   | USD     | 321.677          | 0,09                 | <b>VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE</b>             |           |         |                   |                      |
|   |           |         | <b>321.677</b>   | <b>0,09</b>          | FIRST ABU DHABI BANK<br>6,32 % VRN 04.04.2034   | 312.000   | USD     | 319.381           | 0,09                 |
| <b>NIEDERLANDE</b>                                |           |         |                  |                      |   |           |         | <b>319.381</b>    | <b>0,09</b>          |
| PROSUS 4,987 % 19.01.2052                         | 550.000   | USD     | 405.945          | 0,11                 |   |           |         | <b>405.945</b>    | <b>0,11</b>          |
|   |           |         | <b>405.945</b>   | <b>0,11</b>          |   |           |         |                   |                      |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Asia Bond (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung  | Nennwert  | Währung | Kurswert           | % des Nettovermögens |
|---|-----------|---------|--------------------|----------------------|
| <b>USA</b>  |           |         |                    |                      |
| BROADCOM 3,137 %<br>15.11.2035  | 3.000.000 | USD     | 2.426.563          | 0,68                 |
| HYUNDAI CAPITAL AMERICA<br>2,1 % 15.09.2028   | 2.244.000 | USD     | 1.968.904          | 0,55                 |
| SK BATTERY AMERICA<br>4,875 % 23.01.2027  | 248.000   | USD     | 245.880            | 0,07                 |
| US (GOVT) 4 % 15.02.2034  | 420.000   | USD     | 413.733            | 0,12                 |
|   |           |         | <b>5.055.080</b>   | <b>1,42</b>          |
| <b>SUMME ANLEIHEN</b>   |           |         | <b>94.398.264</b>  | <b>26,32</b>         |
| <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN<br/>MARKT GEHANDELTEN ÜBERTRAGBAREN WERTPAPIERE</b> |           |         | <b>94.398.264</b>  | <b>26,32</b>         |
| <b>SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>  |           |         |                    |                      |
| <b>ANLEIHEN</b>   |           |         |                    |                      |
| <b>CHINA</b>  |           |         |                    |                      |
| REDCO PROPERTIES GROUP<br>9,9 % 17.02.2024**  | 973.000   | USD     | 9.866              | 0,00                 |
| REDCO PROPERTIES GROUP<br>11 % 06.08.2023***  | 203.788   | USD     | 2.626              | 0,00                 |
|   |           |         | <b>12.492</b>      | <b>0,00</b>          |
| <b>HONGKONG</b>   |           |         |                    |                      |
| YANGO JUSTICE INTERNATIONAL<br>9,25 % 15.04.2023****                                | 500.000   | USD     | 3.750              | 0,00                 |
|   |           |         | <b>3.750</b>       | <b>0,00</b>          |
| <b>SUMME ANLEIHEN</b>   |           |         | <b>16.242</b>      | <b>0,00</b>          |
| <b>SUMME SONSTIGE ÜBERTRAGBARE<br/>WERTPAPIERE</b>                                  |           |         | <b>16.242</b>      | <b>0,00</b>          |
| <b>SUMME WERTPAPIERANLAGEN</b>  |           |         | <b>356.274.175</b> | <b>99,32</b>         |
| <b>SONSTIGES NETTOVERMÖGEN</b>  |           |         | <b>2.434.701</b>   | <b>0,68</b>          |
| <b>GESAMTNETTOVERMÖGEN</b>  |           |         | <b>358.708.876</b> | <b>100,00</b>        |

\*\* Der Vermögenswert, der am 17. Februar 2024 fällig war, ist notleidend, Der Ausschuss für die Preisbestimmung und die Verwaltungsgesellschaft haben vereinbart und veranlasst, den beizulegenden Zeitwert des Wertpapiers auf 9,866 USD festzusetzen,

\*\*\* Der Vermögenswert, der am 6. August 2023 fällig war, ist notleidend, Der Ausschuss für die Preisbestimmung und die Verwaltungsgesellschaft haben vereinbart und veranlasst, den beizulegenden Zeitwert des Wertpapiers auf 2,626 USD festzusetzen,

\*\*\*\* Der Vermögenswert, der am 15. April 2023 fällig war, ist notleidend, Der Ausschuss für die Preisbestimmung und die Verwaltungsgesellschaft haben vereinbart und veranlasst, den beizulegenden Zeitwert des Wertpapiers auf 3,750 USD festzusetzen,

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Asia ESG Bond  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Wäh-<br>rung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens | Beschreibung   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Wäh-<br>rung | Kurswert | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |
|---|--------------------------|--------------|------------------|-----------------------------------|--|--------------------------|--------------|----------|-----------------------------------|
| <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>  |                          |              |                  |                                   | <b>BANK OF EAST ASIA</b>                               |                          |              |          |                                   |
| <b>AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |                          |              |                  |                                   | 4 % VRN 29.05.2030                                     |                          |              |          |                                   |
| <b>ANLEIHEN</b>   |                          |              |                  |                                   | 250.000 USD 242.342 0,93                               |                          |              |          |                                   |
| <b>CHINA</b>  |                          |              |                  |                                   | <b>BANK OF EAST ASIA</b>                               |                          |              |          |                                   |
| ALIBABA GROUP HOLDING   |                          |              |                  |                                   | 6,625 % VRN 13.03.2027                                 |                          |              |          |                                   |
| 4,2 % 06.12.2047  | 200.000                  | USD          | 165.044          | 0,63                              | 250.000 USD 252.259 0,97                               |                          |              |          |                                   |
| BAIDU 4,375 % 14.05.2024  | 200.000                  | USD          | 199.644          | 0,77                              | CAS CAPITAL 4 % VRN PERP                               |                          |              |          |                                   |
| CCBL CAYMAN 1,6 %   |                          |              |                  |                                   | 200.000 USD 183.237 0,70                               |                          |              |          |                                   |
| 15.09.2026  |                          |              |                  |                                   | CHINA RESOURCES LAND                                   |                          |              |          |                                   |
| CHINA MENGNIU DAIRY   |                          |              |                  |                                   | 4,125 % 26.02.2029                                     |                          |              |          |                                   |
| 1,875 % 17.06.2025  | 200.000                  | USD          | 182.989          | 0,70                              | 300.000 USD 280.985 1,08                               |                          |              |          |                                   |
| CONTEMPORARY RUIDING DEVE-<br>LOPMENT 1,5 % 09.09.2026            | 200.000                  | USD          | 191.428          | 0,73                              | CMB INTERNATIONAL LEASING<br>MANAGEMENT 2 % 04.02.2026 |                          |              |          |                                   |
| CONTEMPORARY RUIDING DEVE-<br>LOPMENT 1,875 % 17.09.2025          | 200.000                  | USD          | 182.460          | 0,70                              | 200.000 USD 187.787 0,72                               |                          |              |          |                                   |
| GEELY AUTOMOBILE  |                          |              |                  |                                   | CNAC HK FINBRIDGE 3 %                                  |                          |              |          |                                   |
| HOLDINGS 4 % VRN PERP   |                          |              |                  |                                   | 22.09.2030   |                          |              |          |                                   |
| LONGFOR GROUP HOLDINGS  |                          |              |                  |                                   | ELECT GLOBAL INVESTMENTS                               |                          |              |          |                                   |
| 3,95 % 16.09.2029   | 200.000                  | USD          | 189.904          | 0,73                              | 4,10 % VRN PERP  |                          |              |          |                                   |
| SEAZEN GROUP 6 %  |                          |              |                  |                                   | FORTUNE STAR 5,95 %                                    |                          |              |          |                                   |
| 12/08/2024  |                          |              |                  |                                   | 19.10.2025   |                          |              |          |                                   |
| SF HOLDING INVESTMENT   |                          |              |                  |                                   | 200.000 USD 183.315 0,70                               |                          |              |          |                                   |
| 2,875 % 20.02.2030  | 200.000                  | USD          | 197.088          | 0,76                              | GLP CHINA HOLDINGS                                     |                          |              |          |                                   |
| TENCENT MUSIC ENTERTAINMENT                                       |                          |              |                  |                                   | 2,95 % 29.03.2026                                      |                          |              |          |                                   |
| 2,00 % 03.09.2030   | 200.000                  | USD          | 105.367          | 0,40                              | 200.000 USD 161.847 0,62                               |                          |              |          |                                   |
| ZHONGSHENG GROUP  |                          |              |                  |                                   | HKT CAPITAL 3,25 %                                     |                          |              |          |                                   |
| HOLDINGS 3 % 13.01.2026   | 200.000                  | USD          | 160.941          | 0,62                              | 30.09.2029   |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              | <b>2.197.818</b> | <b>8,43</b>                       | HKT CAPITAL NO 4                                       |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |                  |                                   | 3 % 14.07.2026   |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |                  |                                   | 200.000 USD 190.057 0,73                               |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |                  |                                   | HONG KONG (GOVT) 2,375 %                               |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |                  |                                   | 02/02/2051   |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |                  |                                   | 200.000 USD 128.192 0,49                               |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |                  |                                   | HONG KONG (GOVT) 5,25 %                                |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |                  |                                   | 11/01/2053   |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |                  |                                   | 200.000 USD 214.271 0,82                               |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |                  |                                   | HONGKONG LAND FINANCE                                  |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |                  |                                   | 5,25 % 14.07.2033                                      |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |                  |                                   | 200.000 USD 198.793 0,76                               |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |                  |                                   | HUARONG FINANCE 2017                                   |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |                  |                                   | 4,75 % 27.04.2027                                      |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |                  |                                   | 200.000 USD 189.937 0,73                               |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |                  |                                   | ICBCIL FINANCE 2,25 %                                  |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |                  |                                   | 02/11/2026   |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |                  |                                   | 200.000 USD 185.332 0,71                               |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |                  |                                   | LENOVO 3,421 % 02.11.2030                              |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |                  |                                   | 200.000 USD 175.688 0,67                               |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |                  |                                   | LENOVO GROUP 5,831 %                                   |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |                  |                                   | 27.01.2028   |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |                  |                                   | 200.000 USD 202.580 0,78                               |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |                  |                                   | LINK FINANCE 2,75 %                                    |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |                  |                                   | 19.01.2032   |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |                  |                                   | 200.000 USD 169.792 0,65                               |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |                  |                                   | NAN FUNG TREASURY                                      |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |                  |                                   | 3,625 % 27.08.2030                                     |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |                  |                                   | 200.000 USD 173.815 0,67                               |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |                  |                                   | NANYANG COMMERCIAL BANK                                |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |                  |                                   | 3,8 % VRN 20.11.2029                                   |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |                  |                                   | 250.000 USD 246.295 0,95                               |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |                  |                                   | NWD FINANCE 6,15 % VRN                                 |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |                  |                                   | PERP   |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |                  |                                   | 200.000 USD 176.416 0,68                               |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |                  |                                   | <b>5.022.732 19,27</b>                                 |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |                  |                                   | <b>INDIEN</b>  |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |                  |                                   | AXIS BANK 4,1 % VRN PERP                               |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |                  |                                   | 200.000 USD 186.004 0,71                               |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |                  |                                   | RENEW POWER 5,875 %                                    |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |                  |                                   | 05/03/2027   |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |                  |                                   | 291.000 USD 284.457 1,10                               |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |                  |                                   | STATE BANK OF INDIA                                    |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |                  |                                   | LONDON 4,875 % 05.05.2028                              |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |                  |                                   | 200.000 USD 198.423 0,76                               |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |                  |                                   | <b>668.884 2,57</b>                                    |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |                  |                                   | <b>1.470.257 5,64</b>                                  |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |                  |                                   | <b>HONGKONG</b>  |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |                  |                                   | AIA GROUP 2,7 % VRN PERP                               |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |                  |                                   | 200.000 USD 186.828 0,72                               |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |                  |                                   | AIRPORT AUTHORITY 2,5 %                                |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |                  |                                   | 12/01/2032   |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |                  |                                   | 200.000 USD 172.580 0,66                               |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |                  |                                   | AIRPORT AUTHORITY 4,75 %                               |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |                  |                                   | 12/01/2028   |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |                  |                                   | 200.000 USD 200.305 0,77                               |                          |              |          |                                   |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Asia ESG Bond (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Wäh-<br>rung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens | Beschreibung                                       | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Wäh-<br>rung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |
|--|--------------------------|--------------|------------------|-----------------------------------|--|--------------------------|--------------|------------------|-----------------------------------|
| <b>INDONESIEN</b>                                      |                          |              |                  |                                   | <b>PHILIPPINEN</b>                                 |                          |              |                  |                                   |
| BANK NEGARA INDONESIA<br>4,3 % VRN PERP                | 200.000                  | USD          | 185.808          | 0,71                              | PHILIPPINES (GOVT) 5,5 %<br>17.01.2048             | 200.000                  | USD          | 204.338          | 0,78                              |
| HYUNDAI MOTOR MANUFACTURING<br>1,75 % 06.05.2026       | 200.000                  | USD          | 185.058          | 0,71                              |  |                          |              | <b>204.338</b>   | <b>0,78</b>                       |
| INDOFOOD CBP SUKSES<br>MAKMUR 4,805 % 27.04.2052       | 200.000                  | USD          | 164.248          | 0,63                              | <b>SINGAPUR</b>                                    |                          |              |                  |                                   |
| INDONESIA (GOVT) 3,2 %<br>23.09.2061                   | 200.000                  | USD          | 133.253          | 0,51                              | CONTINUUM ENERGY AURA<br>9,5 % 24.02.2027          | 200.000                  | USD          | 208.079          | 0,80                              |
| INDONESIA (GOVT) 3,70 %<br>30.10.2049                  | 200.000                  | USD          | 156.472          | 0,60                              | DBS GROUP HOLDINGS 1,822 %<br>VRN 10.03.2031       | 200.000                  | USD          | 186.281          | 0,71                              |
| INDONESIA (GOVT) 4,35 %<br>11/01/2048                  | 200.000                  | USD          | 175.447          | 0,67                              | DBS GROUP HOLDINGS 3,3 %<br>VRN PERP               | 200.000                  | USD          | 195.149          | 0,75                              |
| INDONESIA (GOVT) 4,45 %<br>15.04.2070                  | 200.000                  | USD          | 168.931          | 0,65                              | MEDCO BELL 6,375 %<br>30.01.2027                   | 200.000                  | USD          | 195.131          | 0,75                              |
| INDONESIA (GOVT) 4,625 %<br>15.04.2043                 | 300.000                  | USD          | 279.584          | 1,07                              | OVERSEA CHINESE BANKING<br>1,832 % VRN 10.09.2030  | 200.000                  | USD          | 189.226          | 0,73                              |
| INDONESIA (GOVT) 4,65 %<br>20.09.2032                  | 200.000                  | USD          | 195.110          | 0,75                              | OVERSEAS CHINESE BANKING<br>4,602 % VRN 15.06.2032 | 200.000                  | USD          | 195.935          | 0,75                              |
| INDONESIA (GOVT) 5,25 %<br>17.01.2042                  | 200.000                  | USD          | 200.782          | 0,77                              | UNITED OVERSEAS BANK<br>1,75 % VRN 16.03.2031      | 200.000                  | USD          | 185.895          | 0,71                              |
| INDONESIA (GOVT) 5,25 %<br>08/01/2047                  | 200.000                  | USD          | 200.746          | 0,77                              | UNITED OVERSEAS BANK<br>3,059 % 07.04.2025         | 200.000                  | USD          | 195.881          | 0,75                              |
| INDONESIA (GOVT) 6,625 %<br>17.02.2037                 | 200.000                  | USD          | 226.067          | 0,87                              | UNITED OVERSEAS BANK<br>3,75 % VRN 15.04.2029      | 200.000                  | USD          | 199.856          | 0,77                              |
| PERTAMINA 6,45 %<br>30.05.2044                         | 200.000                  | USD          | 213.763          | 0,82                              |  |                          |              | <b>1.751.433</b> | <b>6,72</b>                       |
| PERTAMINA GEOTHERMAL<br>ENERGY 5,15 % 27.04.2028       | 200.000                  | USD          | 199.510          | 0,77                              | <b>SÜDKOREA</b>                                    |                          |              |                  |                                   |
| STAR ENGY GEOTHERMAL WAYANG<br>WINDU 6,75 % 24.04.2033 | 200.000                  | USD          | 163.413          | 0,63                              | EXPORTIMPORT BANK OF<br>KOREA 4,625 % 07.06.2033   | 200.000                  | USD          | 196.870          | 0,76                              |
| TOWER BERSAMA<br>INFRASTRUCTURE 2,75 % 20.01.2026      | 200.000                  | USD          | 189.372          | 0,73                              | KB KOOKMIN CARD 4 %<br>09/06/2025                  | 200.000                  | USD          | 196.123          | 0,75                              |
|  |                          |              | <b>3.037.564</b> | <b>11,66</b>                      | KOOKMIN BANK 4,35 % VRN<br>PERP                    | 200.000                  | USD          | 198.785          | 0,76                              |
| <b>JAPAN</b>   |                          |              |                  |                                   | LG ENERGY SOLUTION<br>5,75 % 25.09.2028            | 200.000                  | USD          | 203.138          | 0,78                              |
| FUKOKU MUTUAL LIFE<br>INSURANCE 6,8 % VRN PERP         | 200.000                  | USD          | 210.956          | 0,81                              | NAVER 1,5 % 29.03.2026                             | 300.000                  | USD          | 278.413          | 1,07                              |
| MITSUBISHI UFJ<br>FINANCIAL 8,2 % VRN PERP             | 200.000                  | USD          | 216.142          | 0,83                              | NONGHYUP BANK 4,875 %<br>03/07/2028                | 200.000                  | USD          | 199.209          | 0,76                              |
| MIZUHO FINANCIAL 5,579 %<br>26.05.2035                 | 200.000                  | USD          | 202.757          | 0,78                              | SHINHAN BANK 4,5 %<br>26.03.2028                   | 200.000                  | USD          | 193.017          | 0,74                              |
| SUMITOMO LIFE INSURANCE<br>5,875 % VRN PERP            | 200.000                  | USD          | 199.485          | 0,77                              | SHINHAN CARD 2,5 %<br>27.01.2027                   | 200.000                  | USD          | 184.741          | 0,71                              |
|  |                          |              | <b>829.340</b>   | <b>3,19</b>                       | SHINHAN CARD 5,5 %<br>12/03/2029                   | 200.000                  | USD          | 201.411          | 0,77                              |
| <b>MAURITIUS</b>                                       |                          |              |                  |                                   | SHINHAN FINANCIAL GROUP<br>3,34 % VRN 05.02.2030   | 200.000                  | USD          | 195.541          | 0,75                              |
| GREENKO SOLAR MAURITIUS<br>5,95 % 29.07.2026           | 200.000                  | USD          | 195.197          | 0,75                              | SK HYNIX 5,5 % 16.01.2029                          | 200.000                  | USD          | 199.759          | 0,77                              |
|  |                          |              | <b>195.197</b>   | <b>0,75</b>                       | WOORI BANK 4,875 %<br>26.01.2028                   | 200.000                  | USD          | 200.035          | 0,77                              |
| <b>NIEDERLANDE</b>                                     |                          |              |                  |                                   |  |                          |              | <b>2.447.042</b> | <b>9,39</b>                       |
| GREENKO DUTCH 3,85 %<br>29.03.2026                     | 200.000                  | USD          | 174.185          | 0,67                              | <b>TAIWAN</b>                                      |                          |              |                  |                                   |
| ROYAL CAPITAL 5 % VRN PERP                             | 200.000                  | USD          | 197.231          | 0,76                              | TSMC GLOBAL 0,75 %<br>28.09.2025                   | 200.000                  | USD          | 187.184          | 0,72                              |
|  |                          |              | <b>371.416</b>   | <b>1,43</b>                       | TSMC GLOBAL 1 % 28.09.2027                         | 200.000                  | USD          | 175.191          | 0,67                              |
|  |                          |              |                  |                                   |  |                          |              | <b>362.375</b>   | <b>1,39</b>                       |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Asia ESG Bond (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Wäh-<br>rung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens | Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Wäh-<br>rung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |
|---|--------------------------|--------------|-------------------|-----------------------------------|---|--------------------------|--------------|------------------|-----------------------------------|
| <b>THAILAND</b>   |                          |              |                   |                                   | <b>INDIEN</b>   |                          |              |                  |                                   |
| KASIKORNBANK 5,275 % VRN<br>PERP  | 200.000                  | USD          | 195.244           | 0,75                              | ADANI GREEN ENERGY 6,7 %<br>12/03/2042                      | 200.000                  | USD          | 193.891          | 0,74                              |
| THAI OIL TREASURY CENTER<br>4,875 % 23.01.2043                                      | 200.000                  | USD          | 175.373           | 0,67                              | HDFC BANK 3,7 % VRN PERP<br>HDFC BANK 5,196 %<br>15.02.2027 | 200.000                  | USD          | 184.536          | 0,71                              |
|   |                          |              | <b>370.617</b>    | <b>1,42</b>                       | SHRIRAM FINANCE 6,625 %<br>22.04.2027                       | 200.000                  | USD          | 198.767          | 0,76                              |
| <b>USA</b>  |                          |              |                   |                                   | SHRIRAM TRANSPORT<br>FINANCE 4,15 % 18.07.2025              | 200.000                  | USD          | 200.906          | 0,77                              |
| BOC AVIATION 4,875 %<br>03/05/2033  | 200.000                  | USD          | 196.450           | 0,75                              |   |                          |              | <b>193.903</b>   | <b>0,74</b>                       |
| HYUNDAI CAPITAL AMERICA<br>5,3 % 08.01.2029   | 46.000                   | USD          | 46.089            | 0,18                              |   |                          |              | <b>972.003</b>   | <b>3,72</b>                       |
| US (GOVT) 4,5 % 15.11.2033  | 200.000                  | USD          | 204.766           | 0,79                              | <b>INDONESIEN</b>   |                          |              |                  |                                   |
|   |                          |              | <b>447.305</b>    | <b>1,72</b>                       | PERTAMINA 6,5 % 27.05.2041                                  | 300.000                  | USD          | 321.771          | 1,23                              |
| <b>SUMME ANLEIHEN</b>   |                          |              |                   |                                   |   |                          |              | <b>321.771</b>   | <b>1,23</b>                       |
| <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN<br/>BÖRSE NOTIERTEN WERTPAPIERE<br/>WERTPAPIERE</b> |                          |              |                   |                                   |   |                          |              | <b>321.771</b>   | <b>1,23</b>                       |
|   |                          |              | <b>19.376.318</b> | <b>74,36</b>                      | <b>MAURITIUS</b>  |                          |              |                  |                                   |
| <b>AN EINEM ANDEREM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE, ÜBERTRAGBARE<br/>WERTPAPIERE</b>    |                          |              |                   |                                   | INDIA CLEAN ENERGY<br>HOLDINGS 4,5 % 18.04.2027             | 200.000                  | USD          | 183.581          | 0,70                              |
|   |                          |              | <b>19.376.318</b> | <b>74,36</b>                      | NETWORK 5,65 % VRN PERP                                     | 200.000                  | USD          | 198.604          | 0,77                              |
| <b>ANLEIHEN</b>   |                          |              |                   |                                   |   |                          |              | <b>382.185</b>   | <b>1,47</b>                       |
| <b>AUSTRALIEN</b>   |                          |              |                   |                                   | <b>PHILIPPINEN</b>  |                          |              |                  |                                   |
| COMMONWEALTH BANK OF<br>AUSTRALIA 5,837 % 13.03.2034                                | 200.000                  | USD          | 201.288           | 0,77                              | PHILIPPINE (GOVT) 2,95 %<br>05/05/2045                      | 200.000                  | USD          | 140.803          | 0,54                              |
|   |                          |              | <b>201.288</b>    | <b>0,77</b>                       | PHILIPPINES (GOVT) 3,7 %<br>01/03/2041                      | 300.000                  | USD          | 248.364          | 0,95                              |
| <b>CHINA</b>  |                          |              |                   |                                   | PHILIPPINES (GOVT) 4,2 %<br>29.03.2047                      | 200.000                  | USD          | 169.168          | 0,65                              |
| ALIBABA GROUP 3,15 %<br>09/02/2051  | 200.000                  | USD          | 133.650           | 0,51                              |   |                          |              | <b>558.335</b>   | <b>2,14</b>                       |
| CHINA CINDA FINANCE<br>4,25 % 23.04.2025  | 200.000                  | USD          | 196.983           | 0,76                              | <b>SINGAPUR</b>   |                          |              |                  |                                   |
| MEITUAN DIANPING 3,05 %<br>28.10.2030   | 200.000                  | USD          | 171.659           | 0,66                              | TEMASEK FINANCIAL 2,375 %<br>02/08/2041                     | 250.000                  | USD          | 185.474          | 0,72                              |
|   |                          |              | <b>502.292</b>    | <b>1,93</b>                       | TEMASEK FINANCIAL 2,75 %<br>02/08/2061                      | 250.000                  | USD          | 173.198          | 0,66                              |
| <b>GROSSBRITANNIEN</b>  |                          |              |                   |                                   |   |                          |              | <b>358.672</b>   | <b>1,38</b>                       |
| STANDARD CHARTERED<br>7,875 % VRN PERP  | 200.000                  | USD          | 199.722           | 0,77                              | <b>SÜDKOREA</b>   |                          |              |                  |                                   |
|   |                          |              | <b>199.722</b>    | <b>0,77</b>                       | HANA BANK 3,25 %<br>30.03.2027                              | 200.000                  | USD          | 190.056          | 0,73                              |
| <b>HONGKONG</b>   |                          |              |                   |                                   | HYUNDAI CAPITAL<br>SERVICES 5,125 % 05.02.2027              | 200.000                  | USD          | 198.641          | 0,76                              |
| AIA GROUP 4,95 %<br>04/04/2033  | 200.000                  | USD          | 200.094           | 0,77                              | KOREA GAS 3,875 %<br>13.07.2027                             | 200.000                  | USD          | 193.017          | 0,74                              |
| AIA GROUP 5,375 %<br>05/04/2034   | 200.000                  | USD          | 200.260           | 0,77                              | KT 4 % 08.08.2025   | 200.000                  | USD          | 196.475          | 0,75                              |
| BANGKOK BANK 9,025 %<br>15.03.2029  | 400.000                  | USD          | 458.892           | 1,76                              | SHINHAN BANK 3,75 %<br>20.09.2027                           | 200.000                  | USD          | 189.213          | 0,73                              |
| ICBCIL FINANCE 3,625 %<br>19.05.2026  | 200.000                  | USD          | 193.305           | 0,74                              | SHINHAN FINANCIAL GROUP<br>2,875 % VRN PERP                 | 300.000                  | USD          | 279.188          | 1,07                              |
|   |                          |              | <b>1.052.551</b>  | <b>4,04</b>                       |   |                          |              | <b>1.246.590</b> | <b>4,78</b>                       |
|   |                          |              |                   |                                   | <b>TAIWAN</b>   |                          |              |                  |                                   |
|   |                          |              |                   |                                   | TSMC GLOBAL 1,25 %<br>23.04.2026                            | 200.000                  | USD          | 185.210          | 0,71                              |
|   |                          |              |                   |                                   |   |                          |              | <b>185.210</b>   | <b>0,71</b>                       |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



## Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Asia ESG Bond (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Wäh-<br>rung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |
|---|--------------------------|--------------|-------------------|-----------------------------------|
| <b>USA</b>  |                          |              |                   |                                   |
| BOC AVIATION USA 1,625 %<br>29.04.2024  | 200.000                  | USD          | 199.362           | 0,77                              |
| SK BATTERY AMERICA<br>4,875 % 23.01.2027  | 200.000                  | USD          | 198.290           | 0,76                              |
|   |                          |              | <b>397.652</b>    | <b>1,53</b>                       |
| <b>SUMME ANLEIHEN</b>   |                          |              | <b>6.378.271</b>  | <b>24,47</b>                      |
| <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN<br/>MARKT GEHANDELTEN ÜBERTRAGBAREN WERTPAPIERE</b> |                          |              | <b>6.378.271</b>  | <b>24,47</b>                      |
| <b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>  |                          |              |                   |                                   |
| <b>IRLAND</b>   |                          |              |                   |                                   |
| HSBC GLOBAL LIQUIDITY<br>FUND   | 75.756                   | USD          | 75.756            | 0,29                              |
|   |                          |              | <b>75.756</b>     | <b>0,29</b>                       |
| <b>SUMME ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>                                      |                          |              | <b>75.756</b>     | <b>0,29</b>                       |
| <b>SUMME WERTPAPIERANLAGEN</b>  |                          |              | <b>25.830.345</b> | <b>99,12</b>                      |
| <b>SONSTIGES NETTOVERMÖGEN</b>  |                          |              | <b>230.296</b>    | <b>0,88</b>                       |
| <b>GESAMTNETTOVERMÖGEN</b>  |                          |              | <b>26.060.641</b> | <b>100,00</b>                     |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Asia High Yield Bond  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Wäh-<br>rung | Kurswert | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens | Beschreibung                 | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Wäh-<br>rung | Kurswert | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |
|---|--------------------------|--------------|----------|-----------------------------------|------------------------------|--------------------------|--------------|----------|-----------------------------------|
| <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>  |                          |              |          |                                   | <b>SUNAC CHINA HOLDINGS</b>  |                          |              |          |                                   |
| <b>AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |                          |              |          |                                   | 6,75 % 30.09.2028            |                          |              |          |                                   |
| <b>ANLEIHEN</b>   |                          |              |          |                                   | 3.199.059 USD 263.938 0,04   |                          |              |          |                                   |
| <b>AUSTRALIEN</b>   |                          |              |          |                                   | SUNAC CHINA HOLDINGS 7 %     |                          |              |          |                                   |
| NICKEL INDUSTRIES   |                          |              |          |                                   | 30.09.2029                   |                          |              |          |                                   |
| 11,25 % 21.10.2028  |                          |              |          |                                   | 3.488.535 USD 264.047 0,04   |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |          |                                   | SUNAC CHINA HOLDINGS         |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |          |                                   | 7,25 % 30.09.2030            |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |          |                                   | 3.789.958 USD 262.758 0,04   |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |          |                                   | WENS FOODSTUFFS GROUP        |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |          |                                   | 2,349 % 29.10.2025           |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |          |                                   | 5.786.000 USD 5.267.647 0,79 |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |          |                                   | WEST CHINA CEMENT 4,95 %     |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |          |                                   | 08/07/2026                   |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |          |                                   | 9.820.000 USD 8.281.581 1,23 |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |          |                                   | WYNN MACAU 4,875 %           |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |          |                                   | 01/10/2024                   |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |          |                                   | 2.200.000 USD 2.181.930 0,33 |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |          |                                   | WYNN MACAU 5,125 %           |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |          |                                   | 15.12.2029                   |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |          |                                   | 7.000.000 USD 6.386.924 0,96 |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |          |                                   | WYNN MACAU 5,5 %             |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |          |                                   | 01/10/2027                   |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |          |                                   | 2.600.000 USD                |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |          |                                   | <u>2.490.237</u>             |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |          |                                   | <u>0,37</u>                  |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |          |                                   | <b>58.154.193</b>            |                          |              |          |                                   |
|   |                          |              |          |                                   | <b>8,71</b>                  |                          |              |          |                                   |
| <b>CHINA</b>  |                          |              |          |                                   | <b>GROSSBRITANNIEN</b>       |                          |              |          |                                   |
| CHINA HONGQIAO GROUP  |                          |              |          |                                   | IHS HOLDING 6,25 %           |                          |              |          |                                   |
| 7,75 % 27.03.2025   |                          |              |          |                                   | 29.11.2028                   |                          |              |          |                                   |
| 4.003.000 USD 4.020.196 0,60                                      |                          |              |          |                                   | 2.500.000 USD 2.198.730 0,33 |                          |              |          |                                   |
| EHI CAR SERVICES 7 %  |                          |              |          |                                   | STANDARD CHARTERED           |                          |              |          |                                   |
| 21.09.2026  |                          |              |          |                                   | 4,75 % VRN PERP              |                          |              |          |                                   |
| 4.296.000 USD 3.797.285 0,57                                      |                          |              |          |                                   | 4.800.000 USD 4.002.406 0,60 |                          |              |          |                                   |
| EHI CAR SERVICES 7,75 %   |                          |              |          |                                   | STANDARD CHARTERED           |                          |              |          |                                   |
| 14.11.2024  |                          |              |          |                                   | 7,75 % VRN PERP              |                          |              |          |                                   |
| 5.000.000 USD 5.016.535 0,75                                      |                          |              |          |                                   | 7.000.000 USD 7.100.114 1,07 |                          |              |          |                                   |
| FUQING INVESTMENT MANAGEMENT                                      |                          |              |          |                                   | VEDANTA RESOURCES            |                          |              |          |                                   |
| 3,25 % 23.06.2025   |                          |              |          |                                   | 6,125 % 09.08.2024           |                          |              |          |                                   |
| 2.351.000 USD 2.132.548 0,32                                      |                          |              |          |                                   | 3.189.000 USD 2.641.781 0,40 |                          |              |          |                                   |
| GREENTOWN CHINA   |                          |              |          |                                   | VEDANTA RESOURCES FINANCE    |                          |              |          |                                   |
| HOLDINGS 4,7 % 29.04.2025   |                          |              |          |                                   | 8,95 % 11.03.2025            |                          |              |          |                                   |
| 3.500.000 USD 3.268.114 0,49                                      |                          |              |          |                                   | 7.465.000 USD 5.738.593 0,86 |                          |              |          |                                   |
| LONGFOR GROUP HOLDINGS  |                          |              |          |                                   | VEDANTA RESOURCES FINANCE    |                          |              |          |                                   |
| 3,375 % 13.04.2027  |                          |              |          |                                   | 9,25 % 23.04.2026            |                          |              |          |                                   |
| 2.200.000 USD 1.403.682 0,21                                      |                          |              |          |                                   | 3.529.000 USD 2.884.975 0,43 |                          |              |          |                                   |
| LONGFOR GROUP HOLDINGS  |                          |              |          |                                   | VEDANTA RESOURCES FINANCE    |                          |              |          |                                   |
| 3,95 % 16.09.2029   |                          |              |          |                                   | 13,875 % 21.01.2027          |                          |              |          |                                   |
| 7.500.000 USD 3.951.248 0,59                                      |                          |              |          |                                   | 9.807.000 USD                |                          |              |          |                                   |
| LONGFOR PROPERTIES 4,5 %  |                          |              |          |                                   | <u>4.355.311</u>             |                          |              |          |                                   |
| 16.01.2028  |                          |              |          |                                   | <u>0,65</u>                  |                          |              |          |                                   |
| MODERN LAND CHINA 2 %   |                          |              |          |                                   | <b>28.921.910</b>            |                          |              |          |                                   |
| 28.12.2024  |                          |              |          |                                   | <b>4,34</b>                  |                          |              |          |                                   |
| 820.071 USD 8.043 0,00  |                          |              |          |                                   |                              |                          |              |          |                                   |
| MODERN LAND CHINA 8 %   |                          |              |          |                                   |                              |                          |              |          |                                   |
| 30.12.2024  |                          |              |          |                                   |                              |                          |              |          |                                   |
| 2.160.094 USD 45.115 0,01   |                          |              |          |                                   |                              |                          |              |          |                                   |
| MODERN LAND CHINA 9 %   |                          |              |          |                                   |                              |                          |              |          |                                   |
| 30.12.2025  |                          |              |          |                                   |                              |                          |              |          |                                   |
| 3.480.873 USD 59.582 0,01   |                          |              |          |                                   |                              |                          |              |          |                                   |
| MODERN LAND CHINA 9 %   |                          |              |          |                                   |                              |                          |              |          |                                   |
| 30.12.2026  |                          |              |          |                                   |                              |                          |              |          |                                   |
| 4.641.167 USD 88.821 0,01   |                          |              |          |                                   |                              |                          |              |          |                                   |
| MODERN LAND CHINA 9 %   |                          |              |          |                                   |                              |                          |              |          |                                   |
| 30.12.2027  |                          |              |          |                                   |                              |                          |              |          |                                   |
| 6.773.522 USD 125.900 0,02  |                          |              |          |                                   |                              |                          |              |          |                                   |
| NEW METRO GLOBAL 4,8 %  |                          |              |          |                                   |                              |                          |              |          |                                   |
| 15.12.2024  |                          |              |          |                                   |                              |                          |              |          |                                   |
| 3.839.000 USD 2.035.938 0,31                                      |                          |              |          |                                   |                              |                          |              |          |                                   |
| REDSUN PROPERTIES GROUP   |                          |              |          |                                   |                              |                          |              |          |                                   |
| 7,3 % 21.05.2024  |                          |              |          |                                   |                              |                          |              |          |                                   |
| 2.720.000 USD 35.401 0,01   |                          |              |          |                                   |                              |                          |              |          |                                   |
| SEAZEN GROUP 6 %  |                          |              |          |                                   |                              |                          |              |          |                                   |
| 12/08/2024  |                          |              |          |                                   |                              |                          |              |          |                                   |
| 3.742.000 USD 3.011.214 0,45                                      |                          |              |          |                                   |                              |                          |              |          |                                   |
| SUNAC CHINA HOLDINGS  |                          |              |          |                                   |                              |                          |              |          |                                   |
| 6,5 % 30.09.2027  |                          |              |          |                                   |                              |                          |              |          |                                   |
| 9.004.683 USD 861.323 0,13  |                          |              |          |                                   |                              |                          |              |          |                                   |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Asia High Yield Bond (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung                                  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Wäh-<br>rung | Kurswert  | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens | Beschreibung   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Wäh-<br>rung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |
|---|--------------------------|--------------|-----------|-----------------------------------|--|--------------------------|--------------|--------------------|-----------------------------------|
| CHAMPION PATH HOLDINGS<br>4,85 % 27.01.2028   | 1.500.000                | USD          | 1.366.885 | 0,20                              | NWD FINANCE 4,125 % VRN<br>PERP                          | 13.600.000               | USD          | 7.991.122          | 1,20                              |
| CHONG HING BANK 5,5 %<br>VRN PERP             | 2.820.000                | USD          | 2.749.377 | 0,41                              | NWD FINANCE 5,25 % VRN<br>PERP                           | 6.249.000                | USD          | 4.535.820          | 0,68                              |
| ELECT GLOBAL INVESTMENTS<br>4,10 % VRN PERP   | 4.750.000                | USD          | 4.334.534 | 0,65                              | NWD FINANCE 6,15 % VRN<br>PERP                           | 12.253.000               | USD          | 10.808.139         | 1,61                              |
| FEC FINANCE 7,375 % VRN<br>PERP               | 4.000.000                | USD          | 3.891.353 | 0,58                              | NWD FINANCE 6,25 % PERP<br>NWD MTN 4,125 % 18.07.2029    | 5.000.000                | USD          | 2.767.113          | 0,41                              |
| FORTUNE STAR 5 %<br>18.05.2026                | 8.181.000                | USD          | 7.055.809 | 1,06                              | PINGAN REAL ESTATE<br>CAPITAL 3,45 % 29.07.2026          | 5.008.000                | USD          | 3.846.508          | 0,58                              |
| FORTUNE STAR 5,05 %<br>27.01.2027             | 5.919.000                | USD          | 4.833.896 | 0,72                              | RKPF OVERSEAS 5,9 %<br>05/03/2025                        | 1.867.000                | USD          | 898.966            | 0,13                              |
| FORTUNE STAR 5,95 %<br>19.10.2025             | 5.831.000                | USD          | 5.344.535 | 0,80                              | RKPF OVERSEAS 6 %<br>04/09/2025                          | 546.000                  | USD          | 210.071            | 0,03                              |
| FORTUNE STAR 6,85 %<br>02/07/2024             | 1.124.000                | USD          | 1.104.653 | 0,17                              | RKPF OVERSEAS 6,7 %<br>30.09.2024                        | 4.173.000                | USD          | 2.599.276          | 0,39                              |
| FRANSHION BRILLIANT<br>3,2 % 09.04.2026       | 3.450.000                | USD          | 3.042.119 | 0,46                              | SHUI ON DEVELOPMENT<br>HOLDING 5,5 % 03.03.2025          | 2.817.000                | USD          | 1.945.664          | 0,29                              |
| FWD 5,5 % VRN PERP                            | 2.250.000                | USD          | 1.924.741 | 0,29                              | SHUI ON DEVELOPMENT<br>HOLDING 5,5 % 29.06.2026          | 700.000                  | USD          | 393.297            | 0,06                              |
| GLP CHINA HOLDINGS<br>2,95 % 29.03.2026       | 6.318.000                | USD          | 5.112.735 | 0,77                              | SHUI ON DEVELOPMENT<br>HOLDING 6,15 % 24.08.2024         | 1.575.000                | USD          | 1.388.740          | 0,21                              |
| HOPSON DEVELOPMENT<br>HOLDINGS 7 % 18.05.2024 | 2.182.000                | USD          | 2.111.185 | 0,32                              | STUDIO CITY FINANCE 5 %<br>15.01.2029                    | 9.750.000                | USD          | 8.594.080          | 1,29                              |
| HUARONG FINANCE 3,375 %<br>24.02.2030         | 2.750.000                | USD          | 2.360.027 | 0,35                              | STUDIO CITY FINANCE 6 %<br>15.07.2025                    | 2.000.000                | USD          | 1.972.124          | 0,30                              |
| HUARONG FINANCE 3,875 %<br>13.11.2029         | 2.000.000                | USD          | 1.758.919 | 0,26                              | STUDIO CITY FINANCE 6,5 %<br>15.01.2028                  | 6.091.000                | USD          | 5.808.478          | 0,87                              |
| HUARONG FINANCE 4,25 %<br>07/11/2027          | 6.773.000                | USD          | 6.263.005 | 0,94                              | YANGO JUSTICE INTERNATIONAL<br>8,25 % 25.11.2023*        | 4.395.000                | USD          | 28.728             | 0,00                              |
| HUARONG FINANCE 4,25 %<br>VRN PERP            | 3.066.000                | USD          | 2.949.705 | 0,44                              | YANLORD LAND 5,125 %<br>20.05.2026                       | 6.566.000                | USD          | 5.248.614          | 0,79                              |
| HUARONG FINANCE 4,75 %<br>27.04.2027          | 4.880.000                | USD          | 4.634.465 | 0,69                              |  |                          |              | <b>188.426.602</b> | <b>28,24</b>                      |
| LAI SUN 5 % 28.07.2026                        | 6.859.000                | USD          | 4.177.302 | 0,63                              | <b>INDIEN</b>  |                          |              |                    |                                   |
| LS FINANCE 4,5 % 26.06.2025                   | 1.828.000                | USD          | 1.724.728 | 0,26                              | AXIS BANK 4,1 % VRN PERP<br>DELHI INTERNATIONAL          | 5.500.000                | USD          | 5.115.100          | 0,76                              |
| LS FINANCE 4,8 % 18.06.2026                   | 2.000.000                | USD          | 1.767.468 | 0,26                              | AIRPORT 6,125 % 31.10.2026<br>DELHI INTERNATIONAL        | 4.013.000                | USD          | 3.981.159          | 0,60                              |
| MELCO RESORTS FINANCE<br>4,875 % 06.06.2025   | 6.000.000                | USD          | 5.861.181 | 0,88                              | AIRPORT 6,45 % 04.06.2029<br>GMR HYDERABAD INTERNATIONAL | 2.000.000                | USD          | 1.976.138          | 0,30                              |
| MELCO RESORTS FINANCE<br>5,25 % 26.04.2026    | 7.917.000                | USD          | 7.639.401 | 1,15                              | AIRPORT 4,25 % 27.10.2027<br>INDIABULLS HOUSING          | 1.898.000                | USD          | 1.762.254          | 0,26                              |
| MELCO RESORTS FINANCE<br>5,375 % 04.12.2029   | 7.617.000                | USD          | 6.964.140 | 1,04                              | FINANCE 9,7 % 03.07.2027<br>JSW INFRASTRUCTURE           | 1.792.000                | USD          | 1.792.665          | 0,27                              |
| MELCO RESORTS FINANCE<br>5,625 % 17.07.2027   | 1.500.000                | USD          | 1.435.897 | 0,22                              | 4,95 % 21.01.2029<br>RENEW POWER 5,875 %                 | 4.550.000                | USD          | 4.280.179          | 0,64                              |
| MELCO RESORTS FINANCE<br>5,75 % 21.07.2028    | 7.292.000                | USD          | 6.907.781 | 1,04                              | 05/03/2027<br>RENEW WIND ENERGY 4,5 %                    | 1.903.000                | USD          | 1.860.209          | 0,28                              |
| NANYANG COMMERCIAL BANK<br>6,5 % VRN PERP     | 1.000.000                | USD          | 1.007.936 | 0,15                              | 14.07.2028   | 1.461.000                | USD          | 1.337.159          | 0,20                              |
| NANYANG COMMERCIAL BANK<br>7,35 % VRN PERP    | 1.000.000                | USD          | 1.028.591 | 0,15                              |  |                          |              | <b>22.104.863</b>  | <b>3,31</b>                       |

\* Der Vermögenswert, der am 25. November 2023 fällig war, ist notleidend. Zur Bewertung wurde der letzte verfügbare Preis auf dem Markt herangezogen.

## Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Asia High Yield Bond (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Wäh-<br>rung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens | Beschreibung                                       | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Wäh-<br>rung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |
|--|--------------------------|--------------|-------------------|-----------------------------------|--|--------------------------|--------------|-------------------|-----------------------------------|
| <b>INDONESIEN</b>                                      |                          |              |                   |                                   | NETWORK 3,975 % VRN PERP                           | 4.000.000                | USD          | 3.805.069         | 0,57                              |
| ALAM SUTERA REALTY<br>6,25 % 02.11.2025                | 5.566.000                | USD          | 5.513.911         | 0,83                              |  |                          |              | <b>27.944.259</b> | <b>4,19</b>                       |
| BANK NEGARA INDONESIA<br>4,3 % VRN PERP                | 7.500.000                | USD          | 6.967.794         | 1,04                              | <b>MONGOLEI</b>                                    |                          |              |                   |                                   |
| BUKIT MAKMUR MANDIRI<br>UTAMA 7,75 % 10.02.2026        | 2.981.000                | USD          | 2.972.302         | 0,45                              | MONGOLIAN MINING CORPENENERGY<br>12,5 % 13.09.2026 | 6.840.000                | USD          | 7.385.309         | 1,11                              |
| GAJAH TUNGGAL 8,95 %<br>23.06.2026                     | 1.402.000                | USD          | 1.360.153         | 0,20                              |  |                          |              | <b>7.385.309</b>  | <b>1,11</b>                       |
| JAPFA COMFEED INDONESIA<br>5,375 % 23.03.2026          | 1.742.000                | USD          | 1.607.394         | 0,24                              | <b>NIEDERLANDE</b>                                 |                          |              |                   |                                   |
| PAKUWON JATI 4,875 %<br>29.04.2028                     | 4.402.000                | USD          | 4.126.353         | 0,62                              | MONG DUONG FINANCE<br>HOLDINGS 5,125 % 07.05.2029  | 4.000.000                | USD          | 3.531.497         | 0,53                              |
| STAR ENGY GEOTHERMAL WAYANG<br>WINDU 6,75 % 24.04.2033 | 6.386.000                | USD          | 5.217.789         | 0,78                              |  |                          |              | <b>3.531.497</b>  | <b>0,53</b>                       |
|  |                          |              | <b>27.765.696</b> | <b>4,16</b>                       | <b>PHILIPPINEN</b>                                 |                          |              |                   |                                   |
| <b>JAPAN</b>   |                          |              |                   |                                   | PETRON 5,95 % VRN PERP                             | 3.250.000                | USD          | 3.140.151         | 0,47                              |
| mitsubishi UFJ<br>FINANCIAL 8,2 % VRN PERP             | 2.464.000                | USD          | 2.662.871         | 0,40                              | RIZAL COMMERCIAL<br>BANKING 6,5 % VRN PERP         | 1.750.000                | USD          | 1.723.081         | 0,26                              |
| MIZUHO FINANCIAL 5,579 %<br>26.05.2035                 | 3.091.000                | USD          | 3.133.603         | 0,47                              | SAN MIGUEL 5,5 % VRN PERP                          | 4.622.000                | USD          | 4.515.993         | 0,67                              |
| RAKUTEN GROUP 5,125 %<br>VRN PERP                      | 1.750.000                | USD          | 1.512.909         | 0,23                              | SMC GLOBAL POWER<br>HOLDINGS 5,70 % VRN PERP       | 365.000                  | USD          | 346.013           | 0,05                              |
| RAKUTEN GROUP 6,25 % VRN<br>PERP                       | 1.087.000                | USD          | 816.101           | 0,12                              | SMC GLOBAL POWER<br>HOLDINGS 5,95 % VRN PERP       | 3.527.000                | USD          | 3.441.426         | 0,52                              |
| RAKUTEN GROUP 11,25 %<br>15.02.2027                    | 5.019.000                | USD          | 5.320.986         | 0,79                              | SMC GLOBAL POWER<br>HOLDINGS 6,5 % VRN PERP        | 3.417.000                | USD          | 3.412.259         | 0,51                              |
| SUMITOMO LIFE INSURANCE<br>5,875 % VRN PERP            | 2.328.000                | USD          | 2.322.006         | 0,35                              | SMC GLOBAL POWER<br>HOLDINGS 7 % VRN PERP          | 2.975.000                | USD          | 2.903.362         | 0,44                              |
|  |                          |              | <b>15.768.476</b> | <b>2,36</b>                       |  |                          |              | <b>19.482.285</b> | <b>2,92</b>                       |
| <b>MACAU</b>   |                          |              |                   |                                   | <b>SINGAPUR</b>                                    |                          |              |                   |                                   |
| MGM CHINA HOLDINGS<br>4,75 % 01.02.2027                | 14.000.000               | USD          | 13.356.750        | 2,00                              | CONTINUUM ENERGY AURA<br>9,5 % 24.02.2027          | 7.481.000                | USD          | 7.783.207         | 1,17                              |
| WYNN MACAU 5,625 %<br>26.08.2028                       | 11.808.000               | USD          | 11.201.003        | 1,68                              | GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES<br>3,875 % 04.06.2025   | 15.460.000               | USD          | 13.663.968        | 2,05                              |
|  |                          |              | <b>24.557.753</b> | <b>3,68</b>                       | INDIKA ENERGY CAPITAL<br>8,25 % 22.10.2025         | 3.716.000                | USD          | 3.747.222         | 0,56                              |
| <b>MAURITIUS</b>                                       |                          |              |                   |                                   | MEDCO BELL 6,375 %<br>30.01.2027                   | 2.000.000                | USD          | 1.951.312         | 0,29                              |
| AZURE POWER SOLAR<br>ENERGY 5,65 % 24.12.2024          | 1.782.000                | USD          | 1.736.025         | 0,26                              | MEDCO MAPLE TREE 8,96 %<br>27.04.2029              | 5.243.000                | USD          | 5.462.817         | 0,82                              |
| CLEAN RENEWABLE POWER<br>4,25 % 25.03.2027             | 5.803.000                | USD          | 4.706.053         | 0,71                              | MEDCO OAK TREE 7,375 %<br>14.05.2026               | 5.235.000                | USD          | 5.246.610         | 0,79                              |
| DIAMOND 7,95 % 28.07.2026                              | 4.350.000                | USD          | 4.428.331         | 0,66                              | TML HOLDINGS 4,35 %<br>09/06/2026                  | 2.440.000                | USD          | 2.347.358         | 0,35                              |
| GREENKO SOLAR MAURITIUS<br>5,55 % 29.01.2025           | 6.904.000                | USD          | 6.831.082         | 1,02                              |  |                          |              | <b>40.202.494</b> | <b>6,03</b>                       |
| GREENKO SOLAR MAURITIUS<br>5,95 % 29.07.2026           | 2.500.000                | USD          | 2.439.966         | 0,37                              | <b>SRI LANKA</b>                                   |                          |              |                   |                                   |
| INDIA GREEN POWER<br>HOLDINGS 4 % 22.02.2027           | 4.602.000                | USD          | 3.997.733         | 0,60                              | SRI LANKA (GOVT) 6,2 %<br>11/05/2027               | 3.000.000                | USD          | 1.776.705         | 0,27                              |
|  |                          |              |                   |                                   | SRI LANKA (GOVT) 6,35 %<br>28.06.2024              | 4.705.000                | USD          | 2.787.439         | 0,42                              |
|  |                          |              |                   |                                   | SRI LANKA (GOVT) 6,75 %<br>18.04.2028              | 4.200.000                | USD          | 2.491.042         | 0,37                              |
|  |                          |              |                   |                                   | SRI LANKA (GOVT) 6,825 %<br>18.07.2026             | 1.600.000                | USD          | 959.967           | 0,14                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Asia High Yield Bond (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Wäh-<br>rung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens | Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Wäh-<br>rung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |
|---|--------------------------|--------------|--------------------|-----------------------------------|---|--------------------------|--------------|--------------------|-----------------------------------|
| SRI LANKA (GOVT) 6,85 %<br>14.03.2024**   | 2.090.000                | USD          | 1.154.725          | 0,17                              | <b>HONGKONG</b>   |                          |              |                    |                                   |
| SRI LANKA (GOVT) 7,85 %<br>14.03.2029   | 2.800.000                | USD          | 1.655.979          | 0,25                              | AIA GROUP LTD 5,375 %<br>05/04/2034   | 3.385.000                | USD          | 3.389.407          | 0,51                              |
|   |                          |              | <b>10.825.857</b>  | <b>1,62</b>                       | NEW WORLD CHINA LAND<br>4,75 % 23.01.2027   | 2.520.000                | USD          | 2.239.813          | 0,34                              |
| <b>THAILAND</b>   |                          |              |                    |                                   | STUDIO CITY 7 % 15.02.2027  | 4.434.000                | USD          | 4.442.861          | 0,66                              |
| BANGKOK BANK 3,733 % VRN<br>25.09.2034  | 4.000.000                | USD          | 3.569.080          | 0,53                              |   |                          |              | <b>10.072.081</b>  | <b>1,51</b>                       |
| BANGKOK BANK 5 % VRN<br>PERP  | 10.676.000               | USD          | 10.400.737         | 1,56                              | <b>INDIEN</b>   |                          |              |                    |                                   |
| KASIKORN BANK 5,275 % VRN<br>PERP   | 14.334.000               | USD          | 13.993.151         | 2,10                              | ADANI GREEN ENERGY 6,7 %<br>12/03/2042  | 3.982.000                | USD          | 3.860.361          | 0,58                              |
| KRUNG THAI BANK 4,4 %<br>VRN PERP   | 7.014.000                | USD          | 6.669.670          | 1,00                              | HDFC BANK 3,7 % VRN PERP  | 8.700.000                | USD          | 8.027.296          | 1,21                              |
|   |                          |              | <b>34.632.638</b>  | <b>5,19</b>                       | IRB INFRASTRUCTURE DEVELOPERS<br>7,11 % 11.03.2032                                      | 1.581.000                | USD          | 1.605.441          | 0,24                              |
| <b>USA</b>  |                          |              |                    |                                   | JSW STEEL 3,95 %<br>05/04/2027  | 1.000.000                | USD          | 930.896            | 0,14                              |
| PERIAMA HOLDINGS 5,95 %<br>19.04.2026   | 7.256.000                | USD          | 7.175.805          | 1,07                              | JSW STEEL 5,05 % 05.04.2032   | 5.000.000                | USD          | 4.408.940          | 0,66                              |
| PROLOGIS 3,5 % 06.02.2027   | 12.000.000               | CNY          | 1.664.146          | 0,25                              | SHRIRAM TRANSPORT<br>FINANCE 4,15 % 18.07.2025  | 7.865.000                | USD          | 7.625.231          | 1,14                              |
| RESORTS WORLD LAS VEGAS<br>4,625 % 06.04.2031                                       | 2.700.000                | USD          | 2.355.155          | 0,35                              |   |                          |              | <b>26.458.165</b>  | <b>3,97</b>                       |
| RESORTS WORLD LAS VEGAS<br>8,45 % 27.07.2030  | 4.800.000                | USD          | 5.182.324          | 0,78                              | <b>INDONESIEN</b>   |                          |              |                    |                                   |
| SASOL FINANCING 5,5 %<br>18.03.2031   | 2.000.000                | USD          | 1.689.850          | 0,25                              | FREEPORT INDONESIA 6,2 %<br>14.04.2052  | 7.000.000                | USD          | 6.974.165          | 1,05                              |
| SASOL FINANCING 8,75 %<br>03/05/2029  | 2.000.000                | USD          | 2.037.168          | 0,31                              |   |                          |              | <b>6.974.165</b>   | <b>1,05</b>                       |
|   |                          |              | <b>20.104.448</b>  | <b>3,01</b>                       | <b>MACAU</b>  |                          |              |                    |                                   |
| <b>SUMME ANLEIHEN</b>   |                          |              | <b>532.390.719</b> | <b>79,79</b>                      | WYNN MACAU 5,5 %<br>15.01.2026  | 8.256.000                | USD          | 8.047.097          | 1,21                              |
| <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN<br/>BÖRSE NOTIERTEN WERTPAPIERE<br/>WERTPAPIERE</b> |                          |              | <b>532.390.719</b> | <b>79,79</b>                      |   |                          |              | <b>8.047.097</b>   | <b>1,21</b>                       |
| <b>AN EINEM ANDEREM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE, ÜBERTRAGBARE<br/>WERTPAPIERE</b>    |                          |              |                    |                                   | <b>MAURITIUS</b>  |                          |              |                    |                                   |
| <b>ANLEIHEN</b>   |                          |              |                    |                                   | AZURE POWER ENERGY<br>3,575 % 19.08.2026  | 2.265.000                | USD          | 1.699.688          | 0,25                              |
| <b>AUSTRALIEN</b>   |                          |              |                    |                                   | CA MAGNUM HOLDINGS<br>5,375 % 31.10.2026  | 9.450.000                | USD          | 9.082.404          | 1,36                              |
| CIMIC FINANCE 7 % 25.03.2034  | 2.030.000                | USD          | 2.085.022          | 0,31                              | GREENKO WIND PROJECTS<br>MAURITIUS 5,5 % 06.04.2025                                     | 8.500.000                | USD          | 8.382.391          | 1,26                              |
|   |                          |              | <b>2.085.022</b>   | <b>0,31</b>                       | INDIA CLEAN ENERGY<br>HOLDINGS 4,5 % 18.04.2027   | 4.433.000                | USD          | 4.069.063          | 0,61                              |
| <b>GROSSBRITANNIEN</b>  |                          |              |                    |                                   | NETWORK 5,65 % VRN PERP   | 5.492.000                | USD          | 5.453.674          | 0,82                              |
| STANDARD CHARTERED 4,3 %<br>VRN PERP  | 4.704.000                | USD          | 3.879.743          | 0,58                              |   |                          |              | <b>28.687.220</b>  | <b>4,30</b>                       |
| STANDARD CHARTERED<br>7,875 % VRN PERP  | 12.587.000               | USD          | 12.569.504         | 1,88                              | <b>SINGAPUR</b>   |                          |              |                    |                                   |
|   |                          |              | <b>16.449.247</b>  | <b>2,46</b>                       | CONTINUUM ENERGY<br>LEVANTER 4,5 % 09.02.2027   | 4.280.000                | USD          | 3.522.563          | 0,53                              |
|   |                          |              |                    |                                   |   |                          |              | <b>3.522.563</b>   | <b>0,53</b>                       |
|   |                          |              |                    |                                   | <b>THAILAND</b>   |                          |              |                    |                                   |
|   |                          |              |                    |                                   | TMB BANK 4,9 % VRN PERP   | 3.000.000                | USD          | 2.966.645          | 0,44                              |
|   |                          |              |                    |                                   |   |                          |              | <b>2.966.645</b>   | <b>0,44</b>                       |
|   |                          |              |                    |                                   | <b>SUMME ANLEIHEN</b>   |                          |              | <b>105.262.205</b> | <b>15,78</b>                      |
|   |                          |              |                    |                                   | <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN<br/>MARKT GEHANDELTEN ÜBERTRAGBAREN<br/>WERTPAPIERE</b> |                          |              | <b>105.262.205</b> | <b>15,78</b>                      |

\*\* Der Vermögenswert, der am 14. März 2024 fällig war, ist notleidend. Zur Bewertung wurde der letzte verfügbare Preis auf dem Markt herangezogen.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Asia High Yield Bond (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Wäh-<br>rung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens | Beschreibung                                   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Wäh-<br>rung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |
|--|--------------------------|--------------|------------------|-----------------------------------|--|--------------------------|--------------|--------------------|-----------------------------------|
| <b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>               |                          |              |                  |                                   | <b>USA</b>                                     |                          |              |                    |                                   |
| <b>IRLAND</b>  |                          |              |                  |                                   | FLOURISH CENTURY 6,6 %                         |                          |              |                    |                                   |
| HSBC GLOBAL LIQUIDITY<br>FUND                          | 4.986.456                | USD          | 4.986.456        | 0,75                              | 04.02.2022*****                                | 8.500.000                | USD          | -                  | 0,00                              |
|  |                          |              | <u>4.986.456</u> | <u>0,75</u>                       |  |                          |              | -                  | <u>0,00</u>                       |
| <b>SUMME ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>         |                          |              | <u>4.986.456</u> | <u>0,75</u>                       | <b>SUMME ANLEIHEN</b>                          |                          |              | <b>7.887.977</b>   | <b>1,19</b>                       |
| <b>SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>               |                          |              |                  |                                   | <b>SUMME SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |                          |              |                    |                                   |
| <b>ANLEIHEN</b>  |                          |              |                  |                                   | <b>SUMME WERTPAPIERANLAGEN</b>                 |                          |              |                    |                                   |
| <b>CHINA</b>   |                          |              |                  |                                   | <b>SONSTIGES NETTOVERMÖGEN</b>                 |                          |              |                    |                                   |
| REDCO PROPERTIES GROUP<br>9,9 % 17.02.2024***          | 3.723.000                | USD          | 37.751           | 0,01                              | <b>GESAMTNETTOVERMÖGEN</b>                     |                          |              | <b>667.135.244</b> | <b>100,00</b>                     |
| REDCO PROPERTIES GROUP<br>11 % 06.08.2023****          | 5.580.758                | USD          | 71.908           | 0,01                              |  |                          |              |                    |                                   |
| REDSUN PROPERTIES GROUP<br>9,5 % 20.09.2023*****       | 4.573.000                | USD          | 54.419           | 0,01                              |  |                          |              |                    |                                   |
| REDSUN PROPERTIES GROUP<br>10,5 % 03.10.2022*****      | 2.000.000                | USD          | 23.120           | 0,00                              |  |                          |              |                    |                                   |
|  |                          |              | <u>187.198</u>   | <u>0,03</u>                       |  |                          |              |                    |                                   |
| <b>HONGKONG</b>  |                          |              |                  |                                   |  |                          |              |                    |                                   |
| YANGO JUSTICE INTERNATIONAL<br>9,25 % 15.04.2023*****  | 9.500.000                | USD          | 71.250           | 0,01                              |  |                          |              |                    |                                   |
| YANGO JUSTICE INTERNATIONAL<br>10,25 % 15.09.2020***** | 11.470.000               | USD          | -                | 0,00                              |  |                          |              |                    |                                   |
|  |                          |              | <u>71.250</u>    | <u>0,01</u>                       |  |                          |              |                    |                                   |
| <b>INDONESIEN</b>                                      |                          |              |                  |                                   |  |                          |              |                    |                                   |
| KAWASAN INDUSTRI JABABEKA<br>TBK 7 % 15.12.2027        | 6.749.000                | USD          | 6.192.880        | 0,93                              |  |                          |              |                    |                                   |
|  |                          |              | <u>6.192.880</u> | <u>0,93</u>                       |  |                          |              |                    |                                   |
| <b>NIEDERLANDE</b>                                     |                          |              |                  |                                   |  |                          |              |                    |                                   |
| IHS NETHERLANDS HOLDCO<br>8 % 18.09.2027               | 1.500.000                | USD          | 1.436.649        | 0,22                              |  |                          |              |                    |                                   |
|  |                          |              | <u>1.436.649</u> | <u>0,22</u>                       |  |                          |              |                    |                                   |

\*\*\* Der Vermögenswert, der am 17. Februar 2024 fällig war, ist notleidend. Der Ausschuss für die Preisbestimmung und die Verwaltungsgesellschaft haben vereinbart und veranlasst, den beizulegenden Zeitwert des Wertpapiers auf 37.751 USD festzusetzen,  
\*\*\*\* Der Vermögenswert, der am 6. August 2023 fällig war, ist notleidend. Der Ausschuss für die Preisbestimmung und die Verwaltungsgesellschaft haben vereinbart und veranlasst, den beizulegenden Zeitwert des Wertpapiers auf 71.908 USD festzusetzen,  
\*\*\*\*\* Der Vermögenswert, der am 20. September 2023 fällig war, ist notleidend. Der Ausschuss für die Preisbestimmung und die Verwaltungsgesellschaft haben vereinbart und veranlasst, den beizulegenden Zeitwert des Wertpapiers auf 54.419 USD festzusetzen,  
\*\*\*\*\* Der Vermögenswert, der am 3. Oktober 2022 fällig war, ist notleidend. Der Ausschuss für die Preisbestimmung und die Verwaltungsgesellschaft haben vereinbart und veranlasst, den beizulegenden Zeitwert des Wertpapiers auf 23.120 USD festzusetzen,  
\*\*\*\*\* Der Vermögenswert, der am 15. April 2023 fällig war, ist notleidend. Der Ausschuss für die Preisbestimmung und die Verwaltungsgesellschaft haben vereinbart und veranlasst, den beizulegenden Zeitwert des Wertpapiers auf 71.250 USD festzusetzen,  
\*\*\*\*\* Der Vermögenswert, der am 15. September 2020 fällig war, ist notleidend. Der Ausschuss für die Preisbestimmung und die Verwaltungsgesellschaft haben vereinbart und veranlasst, das Wertpapier auf null abzuschreiben.  
\*\*\*\*\* Der Vermögenswert, der am 4. Februar 2022 fällig war, ist notleidend. Der Ausschuss für die Preisbestimmung und die Verwaltungsgesellschaft haben vereinbart und veranlasst, das Wertpapier auf null abzuschreiben.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Asian Currencies Bond  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung  | Nennwert      | Währung | Kurswert         | % des Nettovermögens | Beschreibung                             | Nennwert   | Währung | Kurswert         | % des Nettovermögens |
|---|---------------|---------|------------------|----------------------|--|------------|---------|------------------|----------------------|
| <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>  |               |         |                  |                      | <b>MALAYSIA</b>                          |            |         |                  |                      |
| <b>AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |               |         |                  |                      | MALAYSIA (GOVT) 2,632 %<br>15.04.2031    |            |         |                  |                      |
|   |               |         |                  |                      |  | 600.000    | MYR     | 118.064          | 0,50                 |
|   |               |         |                  |                      | MALAYSIA (GOVT) 3,502 %<br>31.05.2027    |            |         |                  |                      |
|   |               |         |                  |                      |  | 1.150.000  | MYR     | 243.208          | 1,04                 |
|   |               |         |                  |                      | MALAYSIA (GOVT) 3,733 %<br>15.06.2028    |            |         |                  |                      |
|   |               |         |                  |                      |  | 800.000    | MYR     | 170.076          | 0,73                 |
|   |               |         |                  |                      | MALAYSIA (GOVT) 3,882 %<br>14.03.2025    |            |         |                  |                      |
|   |               |         |                  |                      |  | 500.000    | MYR     | 106.197          | 0,45                 |
|   |               |         |                  |                      | MALAYSIA (GOVT) 3,899 %<br>16.11.2027    |            |         |                  |                      |
|   |               |         |                  |                      |  | 600.000    | MYR     | 128.481          | 0,55                 |
|   |               |         |                  |                      | MALAYSIA (GOVT) 3,9 %<br>30.11.2026      |            |         |                  |                      |
|   |               |         |                  |                      |  | 1.000.000  | MYR     | 213.927          | 0,91                 |
|   |               |         |                  |                      | MALAYSIA (GOVT) 3,906 %<br>15.07.2026    |            |         |                  |                      |
|   |               |         |                  |                      |  | 800.000    | MYR     | 170.963          | 0,73                 |
|   |               |         |                  |                      | MALAYSIA (GOVT) 4,065 %<br>15.06.2050    |            |         |                  |                      |
|   |               |         |                  |                      |  | 1.000.000  | MYR     | 207.781          | 0,89                 |
|   |               |         |                  |                      | MALAYSIA (GOVT) 4,642 %<br>07/11/2033    |            |         |                  |                      |
|   |               |         |                  |                      |  | 800.000    | MYR     | 179.892          | 0,77                 |
|   |               |         |                  |                      | MALAYSIA (GOVT) 4,762 %<br>07/04/2037    |            |         |                  |                      |
|   |               |         |                  |                      |  | 500.000    | MYR     | 114.347          | 0,49                 |
|   |               |         |                  |                      | MALAYSIA (GOVT) 4,893 %<br>08/06/2038    |            |         |                  |                      |
|   |               |         |                  |                      |  | 1.200.000  | MYR     | 279.209          | 1,19                 |
|   |               |         |                  |                      | MALAYSIA (GOVT) 4,921 %<br>06/07/2048    |            |         |                  |                      |
|   |               |         |                  |                      |  | 500.000    | MYR     | 117.941          | 0,50                 |
|   |               |         |                  |                      |  |            |         | <b>2.050.086</b> | <b>8,75</b>          |
| <b>INDONESIEN</b>   |               |         |                  |                      | <b>PHILIPPINEN</b>                       |            |         |                  |                      |
| INDONESIA (GOVT) 5,125 %<br>15.04.2027                            | 2.500.000.000 | IDR     | 152.221          | 0,65                 | PHILIPPINE (GOVT)<br>2,875 % 09.07.2030  | 7.000.000  | PHP     | 103.389          | 0,44                 |
| INDONESIA (GOVT) 5,5 %<br>15.04.2026                              | 7.000.000.000 | IDR     | 434.676          | 1,86                 | PHILIPPINES (GOVT)<br>3,625 % 22.04.2028 | 10.000.000 | PHP     | 162.021          | 0,69                 |
| INDONESIA (GOVT) 6,125 %<br>15.05.2028                            | 1.700.000.000 | IDR     | 105.717          | 0,45                 | PHILIPPINES (GOVT)<br>3,625 % 21.03.2033 | 5.000.000  | PHP     | 73.335           | 0,31                 |
| INDONESIA (GOVT) 6,375 %<br>15.08.2028                            | 2.500.000.000 | IDR     | 156.846          | 0,67                 | PHILIPPINES (GOVT)<br>4,625 % 02.06.2027 | 10.000.000 | PHP     | 170.518          | 0,72                 |
| INDONESIA (GOVT) 6,375 %<br>15.04.2032                            | 1.500.000.000 | IDR     | 93.555           | 0,40                 | PHILIPPINE (GOVT)<br>4,625 % 09.09.2040  | 7.000.000  | PHP     | 104.381          | 0,45                 |
| INDONESIA (GOVT) 6,5 %<br>15.02.2031                              | 1.000.000.000 | IDR     | 62.871           | 0,27                 | PHILIPPINE (GOVT)<br>4,75 % 04/05/2027   | 5.000.000  | PHP     | 85.705           | 0,37                 |
| INDONESIA (GOVT) 6,625 %<br>15.05.2033                            | 1.500.000.000 | IDR     | 94.791           | 0,40                 | PHILIPPINE (GOVT)<br>4,875 % 20.01.2032  | 5.000.000  | PHP     | 81.586           | 0,35                 |
| INDONESIA (GOVT) 6,625 %<br>15.02.2034                            | 1.000.000.000 | IDR     | 62.984           | 0,27                 | PHILIPPINES (GOVT)<br>6,125 % 24.10.2037 | 2.000.000  | PHP     | 35.388           | 0,15                 |
| INDONESIA (GOVT) 6,875 %<br>15.08.2051                            | 800.000.000   | IDR     | 50.317           | 0,21                 | PHILIPPINE (GOVT) 6,25 %<br>25.01.2034   | 8.000.000  | PHP     | 142.841          | 0,61                 |
| INDONESIA (GOVT) 7 %<br>15.09.2030                                | 6.000.000.000 | IDR     | 386.357          | 1,65                 | PHILIPPINE (GOVT) 6,25 %<br>20.04.2036   | 4.000.000  | PHP     | 71.447           | 0,31                 |
| INDONESIA (GOVT) 7 %<br>15.02.2033                                | 3.000.000.000 | IDR     | 193.321          | 0,83                 | PHILIPPINE (GOVT) 6,625 %<br>17.08.2033  | 5.000.000  | PHP     | 91.634           | 0,39                 |
| INDONESIA (GOVT) 7,125 %<br>15.06.2038                            | 2.500.000.000 | IDR     | 160.575          | 0,69                 | PHILIPPINE (GOVT)<br>6,875 % 10.01.2029  | 4.000.000  | PHP     | 73.263           | 0,31                 |
| INDONESIA (GOVT) 7,125 %<br>15.06.2042                            | 1.500.000.000 | IDR     | 96.561           | 0,41                 |  |            |         |                  |                      |
| INDONESIA (GOVT) 7,125 %<br>15.06.2043                            | 900.000.000   | IDR     | 57.931           | 0,25                 |  |            |         |                  |                      |
| INDONESIA (GOVT) 7,375 %<br>15.05.2048                            | 3.920.000.000 | IDR     | 260.985          | 1,11                 |  |            |         |                  |                      |
| INDONESIA (GOVT) 7,5 %<br>15.08.2032                              | 1.500.000.000 | IDR     | 99.856           | 0,43                 |  |            |         |                  |                      |
| INDONESIA (GOVT) 7,5 %<br>15.06.2035                              | 1.500.000.000 | IDR     | 100.202          | 0,43                 |  |            |         |                  |                      |
| INDONESIA (GOVT) 7,5 %<br>15.05.2038                              | 1.000.000.000 | IDR     | 66.777           | 0,29                 |  |            |         |                  |                      |
| INDONESIA (GOVT) 7,5 %<br>15.04.2040                              | 1.500.000.000 | IDR     | 100.207          | 0,43                 |  |            |         |                  |                      |
| INDONESIA (GOVT) 8,25 %<br>15.05.2036                             | 1.700.000.000 | IDR     | 120.207          | 0,51                 |  |            |         |                  |                      |
| INDONESIA (GOVT) 8,375 %<br>15.03.2034                            | 1.200.000.000 | IDR     | 85.074           | 0,36                 |  |            |         |                  |                      |
| INDONESIA (GOVT) 8,375 %<br>15.04.2039                            | 2.000.000.000 | IDR     | 143.407          | 0,61                 |  |            |         |                  |                      |
|   |               |         | <b>3.085.438</b> | <b>13,18</b>         |  |            |         |                  |                      |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Asian Currencies Bond (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung  | Nennwert  | Wäh-<br>rung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens | Beschreibung                           | Nennwert    | Wäh-<br>rung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |
|---|-----------|--------------|------------------|-----------------------------------|--|-------------|--------------|------------------|-----------------------------------|
| PHILIPPINES (GOVT)<br>7,25 % 23.06.2032               | 2.000.000 | PHP          | 37.897           | 0,16                              | SINGAPORE (GOVT) 3,375 %<br>01/09/2033 | 300.000     | SGD          | 227.606          | 0,97                              |
| PHILIPPINES (GOVT)<br>8,125 % 16.12.2035              | 2.000.000 | PHP          | 41.121           | 0,18                              | TEMASEK FINANCIAL 1,8 %<br>24.11.2026  | 250.000     | SGD          | 177.358          | 0,76                              |
| PHILIPPINES (GOVT)<br>8,125 % 24.11.2042              | 4.000.000 | PHP          | 85.837           | 0,37                              |  |             |              | <b>5.312.921</b> | <b>22,69</b>                      |
|   |           |              | <b>1.360.363</b> | <b>5,81</b>                       | <b>SÜDKOREA</b>                        |             |              |                  |                                   |
| <b>SINGAPUR</b>                                       |           |              |                  |                                   | KOREA (GOVT) 1,125 %<br>10/09/2025     | 300.000.000 | KRW          | 215.527          | 0,92                              |
| ASCENDAS REAL ESTATE<br>INVESTMENT 3,468 % 19.04.2029 | 250.000   | SGD          | 183.809          | 0,78                              | KOREA (GOVT) 1,25 %<br>10/03/2026      | 230.000.000 | KRW          | 163.931          | 0,70                              |
| CHANGI AIRPORT GROUP<br>SINGAPORE 1,88 % 12.05.2031   | 250.000   | SGD          | 164.625          | 0,70                              | KOREA (GOVT) 1,125 %<br>10/09/2039     | 100.000.000 | KRW          | 54.313           | 0,23                              |
| HOUSING DEVELOPMENT<br>BOARD 1,971 % 25.01.2029       | 250.000   | SGD          | 174.471          | 0,75                              | KOREA (GOVT) 1,375 %<br>10/12/2029     | 150.000.000 | KRW          | 99.745           | 0,43                              |
| HOUSING AND DEVELOPMENT<br>BOARD 2,32 % 24.01.2028    | 250.000   | SGD          | 178.780          | 0,76                              | KOREA (GOVT) 1,375 %<br>10/06/2030     | 250.000.000 | KRW          | 164.614          | 0,70                              |
| HOUSING AND DEVELOPMENT<br>BOARD 2,545 % 04.07.2031   | 250.000   | SGD          | 176.972          | 0,76                              | KOREA (GOVT) 1,5 %<br>10/03/2025       | 100.000.000 | KRW          | 72.891           | 0,31                              |
| PSA TREASURY 2,88 %<br>27.04.2027                     | 500.000   | SGD          | 359.519          | 1,54                              | KOREA (GOVT) 1,5 %<br>10/12/2026       | 200.000.000 | KRW          | 141.330          | 0,60                              |
| SINGAPORE (GOVT) 0,5 %<br>01/11/2025                  | 350.000   | SGD          | 247.804          | 1,06                              | KOREA (GOVT) 1,5 %<br>10/12/2030       | 220.000.000 | KRW          | 144.808          | 0,62                              |
| SINGAPORE (GOVT) 1,25 %<br>01/11/2026                 | 250.000   | SGD          | 176.294          | 0,75                              | KOREA (GOVT) 1,5 %<br>10/09/2036       | 200.000.000 | KRW          | 120.171          | 0,51                              |
| SINGAPORE (GOVT) 1,625 %<br>01/07/2031                | 50.000    | SGD          | 33.564           | 0,14                              | KOREA (GOVT) 1,5 %<br>10/09/2040       | 160.000.000 | KRW          | 91.143           | 0,39                              |
| SINGAPORE (GOVT) 1,875 %<br>01/03/2050                | 530.000   | SGD          | 314.587          | 1,34                              | KOREA (GOVT) 1,5 %<br>10/03/2050       | 150.000.000 | KRW          | 79.570           | 0,34                              |
| SINGAPORE (GOVT) 1,875 %<br>01/10/2051                | 620.000   | SGD          | 364.731          | 1,56                              | KOREA (GOVT) 1,75 %<br>10/09/2026      | 200.000.000 | KRW          | 142.871          | 0,61                              |
| SINGAPORE (GOVT) 2,125 %<br>01/06/2026                | 500.000   | SGD          | 361.364          | 1,54                              | KOREA (GOVT) 1,875 %<br>10/06/2029     | 180.000.000 | KRW          | 123.966          | 0,53                              |
| SINGAPORE (GOVT) 2,25 %<br>01/08/2036                 | 500.000   | SGD          | 339.090          | 1,45                              | KOREA (GOVT) 1,875 %<br>10/09/2041     | 100.000.000 | KRW          | 59.792           | 0,26                              |
| SINGAPORE (GOVT) 2,375 %<br>01/06/2025                | 300.000   | SGD          | 219.444          | 0,94                              | KOREA (GOVT) 1,875 %<br>10/03/2051     | 300.000.000 | KRW          | 168.351          | 0,72                              |
| SINGAPORE (GOVT) 2,625 %<br>01/05/2028                | 125.000   | SGD          | 91.118           | 0,39                              | KOREA (GOVT) 2 %<br>10/06/2031         | 250.000.000 | KRW          | 168.901          | 0,72                              |
| SINGAPORE (GOVT) 2,625 %<br>01/08/2032                | 200.000   | SGD          | 143.334          | 0,61                              | KOREA (GOVT) 2 %<br>10/03/2046         | 246.000.000 | KRW          | 144.730          | 0,62                              |
| SINGAPORE (GOVT) 2,75 %<br>01/04/2042                 | 590.000   | SGD          | 420.447          | 1,80                              | KOREA (GOVT) 2 %<br>10/03/2049         | 250.000.000 | KRW          | 145.090          | 0,62                              |
| SINGAPORE (GOVT) 2,75 %<br>01/03/2046                 | 450.000   | SGD          | 318.537          | 1,36                              | KOREA (GOVT) 2,125 %<br>10/06/2027     | 300.000.000 | KRW          | 214.395          | 0,92                              |
| SINGAPORE (GOVT) 2,875 %<br>01/09/2027                | 200.000   | SGD          | 147.209          | 0,63                              | KOREA (GOVT) 2,125 %<br>10/03/2047     | 250.000.000 | KRW          | 150.001          | 0,64                              |
| SINGAPORE (GOVT) 2,875 %<br>01/07/2029                | 300.000   | SGD          | 220.637          | 0,94                              | KOREA (GOVT) 2,25 %<br>10/06/2025      | 280.000.000 | KRW          | 204.950          | 0,88                              |
| SINGAPORE (GOVT) 2,875 %<br>01/09/2030                | 320.000   | SGD          | 234.542          | 1,00                              | KOREA (GOVT) 2,25 %<br>10/12/2025      | 110.000.000 | KRW          | 80.091           | 0,34                              |
| SINGAPORE (GOVT) 3 %<br>01/08/2072                    | 50.000    | SGD          | 37.079           | 0,16                              | KOREA (GOVT) 2,375 %<br>10/03/2027     | 350.000.000 | KRW          | 252.737          | 1,08                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Asian Currencies Bond (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung                              | Nennwert    | Währung | Kurswert         | % des Nettovermögens | Beschreibung   | Nennwert   | Währung | Kurswert          | % des Nettovermögens |
|---|-------------|---------|------------------|----------------------|--|------------|---------|-------------------|----------------------|
| KOREA (GOVT) 2,375 %<br>10/09/2038        | 90.000.000  | KRW     | 58.971           | 0,25                 | THAILAND (GOVT) 2,875 %<br>17.06.2046                            | 6.000.000  | THB     | 160.511           | 0,69                 |
| KOREA (GOVT) 2,5 %<br>10/03/2052          | 100.000.000 | KRW     | 63.415           | 0,27                 | THAILAND (GOVT) 3,3 %<br>17.06.2038                              | 4.000.000  | THB     | 116.849           | 0,50                 |
| KOREA (GOVT) 2,625 %<br>10/09/2035        | 60.000.000  | KRW     | 41.338           | 0,18                 | THAILAND (GOVT) 3,4 %<br>17.06.2036                              | 1.000.000  | THB     | 29.565            | 0,13                 |
| KOREA (GOVT) 2,625 %<br>10/03/2048        | 300.000.000 | KRW     | 197.642          | 0,84                 | THAILAND (GOVT) 3,45 %<br>17.06.2043                             | 1.300.000  | THB     | 37.967            | 0,16                 |
| KOREA (GOVT) 3,00 %<br>10/12/2042         | 145.000.000 | KRW     | 101.752          | 0,43                 | THAILAND (GOVT) 3,6 %<br>17.06.2067                              | 11.000.000 | THB     | 306.173           | 1,31                 |
| KOREA (GOVT) 3,125 %<br>10/06/2025        | 400.000.000 | KRW     | 295.775          | 1,26                 | THAILAND (GOVT) 3,65 %<br>20.06.2031                             | 6.000.000  | THB     | 178.714           | 0,76                 |
| KOREA (GOVT) 3,125 %<br>10/09/2027        | 300.000.000 | KRW     | 221.021          | 0,94                 | THAILAND (GOVT) 3,775 %<br>25.06.2032                            | 2.000.000  | THB     | 60.399            | 0,26                 |
| KOREA (GOVT) 3,25 %<br>10/03/2053         | 420.000.000 | KRW     | 309.531          | 1,32                 | THAILAND (GOVT) 3,85 %<br>12/12/2025                             | 10.000.000 | THB     | 282.485           | 1,21                 |
| KOREA (GOVT) 3,375 %<br>10/06/2032        | 100.000.000 | KRW     | 73.963           | 0,32                 |  |            |         | <b>2.340.525</b>  | <b>10,00</b>         |
| KOREA (GOVT) 3,5 %<br>10/09/2028          | 150.000.000 | KRW     | 112.034          | 0,48                 | <b>SUMME ANLEIHEN</b>  |            |         | <b>19.577.493</b> | <b>83,61</b>         |
| KOREA (GOVT) 3,875 %<br>10/09/2043        | 70.000.000  | KRW     | 55.734           | 0,24                 | <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN</b>                              |            |         |                   |                      |
| KOREA (GOVT) 4 %<br>10/12/2031            | 100.000.000 | KRW     | 77.080           | 0,33                 | <b>BÖRSE NOTIERTEN WERTPAPIERE</b>                               |            |         | <b>19.577.493</b> | <b>83,61</b>         |
| KOREA (GOVT) 4,125 %<br>10/12/2033        | 270.000.000 | KRW     | 212.727          | 0,91                 | <b>WERTPAPIERE</b>   |            |         |                   |                      |
| KOREA (GOVT) 4,25 %<br>10/12/2025         | 200.000.000 | KRW     | 150.507          | 0,64                 | <b>AN EINEM ANDEREM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE, ÜBERTRAGBARE</b> |            |         |                   |                      |
| KOREA (GOVT) 4,25 %<br>10/12/2032         | 200.000.000 | KRW     | 157.626          | 0,67                 | <b>WERTPAPIERE</b>   |            |         |                   |                      |
| KOREA TREASURY BOND<br>3,625 % 10.09.2053 | 120.000.000 | KRW     | 95.126           | 0,41                 | <b>ANLEIHEN</b>  |            |         |                   |                      |
|   |             |         | <b>5.428.160</b> | <b>23,18</b>         | <b>MALAYSIA</b>  |            |         |                   |                      |
| <b>THAILAND</b>                           |             |         |                  |                      | MALAYSIA (GOVT) 3,757 %<br>22.05.2040                            | 1.000.000  | MYR     | 205.400           | 0,88                 |
| THAILAND (GOVT) 1,6 %<br>17.12.2029       | 6.000.000   | THB     | 158.969          | 0,68                 | MALAYSIA (GOVT) 4,127 %<br>15.04.2032                            | 600.000    | MYR     | 129.376           | 0,55                 |
| THAILAND (GOVT) 1,6 %<br>17.06.2035       | 5.000.000   | THB     | 124.440          | 0,53                 | MALAYSIA (GOVT) 4,457 %<br>31.03.2053                            | 200.000    | MYR     | 44.260            | 0,19                 |
| THAILAND (GOVT) 1,585 %<br>17.12.2035     | 4.000.000   | THB     | 98.555           | 0,42                 | MALAYSIA (GOVT) 4,498 %<br>15.04.2030                            | 1.200.000  | MYR     | 264.004           | 1,12                 |
| THAILAND (GOVT) 1,875 %<br>17.06.2049     | 3.000.000   | THB     | 64.123           | 0,27                 | MALAYSIA (GOVT) 4,504 %<br>30.04.2029                            | 1.000.000  | MYR     | 219.952           | 0,94                 |
| THAILAND (GOVT) 2 %<br>17.12.2031         | 8.000.000   | THB     | 213.312          | 0,91                 | MALAYSIA (GOVT) 4,696 %<br>15.10.2042                            | 1.100.000  | MYR     | 251.904           | 1,08                 |
| THAILAND (GOVT) 2 %<br>17.06.2042         | 3.000.000   | THB     | 72.281           | 0,31                 |  |            |         | <b>1.114.896</b>  | <b>4,76</b>          |
| THAILAND (GOVT) 2,125 %<br>17.12.2026     | 8.000.000   | THB     | 219.564          | 0,94                 | <b>PHILIPPINEN</b>   |            |         |                   |                      |
| THAILAND (GOVT) 2,75 %<br>17.06.2052      | 3.000.000   | THB     | 75.297           | 0,32                 | PHILIPPINE (GOVT) 5,75 %<br>16.08.2037                           | 2.750.000  | PHP     | 46.961            | 0,20                 |
| THAILAND (GOVT) 2,875 %<br>17.12.2028     | 5.000.000   | THB     | 141.321          | 0,60                 | PHILIPPINES (GOVT)<br>5,875 % 02.02.2032                         | 1.300.000  | PHP     | 22.567            | 0,10                 |
|   |             |         |                  |                      | PHILIPPINES (GOVT)<br>5,875 % 01.03.2032                         | 1.500.000  | PHP     | 26.130            | 0,11                 |
|   |             |         |                  |                      | PHILIPPINE (GOVT) 6,75 %<br>24.01.2039                           | 6.000.000  | PHP     | 112.556           | 0,48                 |
|   |             |         |                  |                      | PHILIPPINE (GOVT)<br>7,625 % 29.09.2036                          | 2.300.000  | PHP     | 45.926            | 0,20                 |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Asian Currencies Bond (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung   | Nennwert    | Wäh-<br>rung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |
|--|-------------|--------------|-------------------|-----------------------------------|
| PHILIPPINES (GOVT) 8 %<br>19.07.2031   | 4.000.000   | PHP          | 78.386            | 0,33                              |
|  |             |              | <b>332.526</b>    | <b>1,42</b>                       |
| <b>SINGAPUR</b>  |             |              |                   |                                   |
| SINGAPORE (GOVT) 3,5 %<br>01/03/2027   | 200.000     | SGD          | 149.683           | 0,64                              |
|  |             |              | <b>149.683</b>    | <b>0,64</b>                       |
| <b>SÜDKOREA</b>  |             |              |                   |                                   |
| KOREA (GOVT) 1,875 %<br>10/06/2026   | 400.000.000 | KRW          | 287.510           | 1,23                              |
|  |             |              | <b>287.510</b>    | <b>1,23</b>                       |
| <b>SUMME ANLEIHEN</b>  |             |              | <b>1.884.615</b>  | <b>8,05</b>                       |
| <b>SUMME DER AN EINER GEREGELTEN<br/>MARKT GEHANDELTEN ÜBERTRAGBAREN WERTPAPIERE</b> |             |              | <b>1.884.615</b>  | <b>8,05</b>                       |
| <b>SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>   |             |              |                   |                                   |
| <b>ANLEIHEN</b>  |             |              |                   |                                   |
| <b>MALAYSIA</b>  |             |              |                   |                                   |
| MALAYSIA (GOVT) 3,582 %<br>15.07.2032  | 300.000     | MYR          | 62.280            | 0,27                              |
| MALAYSIA (GOVT) 3,828 %<br>05/07/2034  | 800.000     | MYR          | 168.952           | 0,72                              |
| MALAYSIA (GOVT) 3,844 %<br>15.04.2033  | 800.000     | MYR          | 169.053           | 0,72                              |
| MALAYSIA (GOVT) 3,955 %<br>15.09.2025  | 1.500.000   | MYR          | 319.845           | 1,36                              |
| MALAYSIA (GOVT) 4,736 %<br>15.03.2046  | 600.000     | MYR          | 137.460           | 0,59                              |
|  |             |              | <b>857.590</b>    | <b>3,66</b>                       |
| <b>THAILAND</b>  |             |              |                   |                                   |
| THAILAND (GOVT) 3,35 %<br>17.06.2033   | 6.000.000   | THB          | 175.738           | 0,75                              |
| THAILAND (GOVT) 1 %<br>17.06.2027  | 7.000.000   | THB          | 185.180           | 0,79                              |
| THAILAND (GOVT) 2,4 %<br>17.03.2029  | 5.000.000   | THB          | 138.270           | 0,59                              |
| THAILAND (GOVT) 2,65 %<br>17.06.2028   | 6.500.000   | THB          | 181.671           | 0,78                              |
| THAILAND (GOVT) 3,39 %<br>17.06.2037   | 2.000.000   | THB          | 58.996            | 0,25                              |
|  |             |              | <b>739.855</b>    | <b>3,16</b>                       |
| <b>SUMME ANLEIHEN</b>  |             |              | <b>1.597.445</b>  | <b>6,82</b>                       |
| <b>SUMME SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>                                       |             |              | <b>1.597.445</b>  | <b>6,82</b>                       |
| <b>SUMME WERTPAPIERANLAGEN</b>   |             |              | <b>23.059.553</b> | <b>98,48</b>                      |
| <b>SONSTIGES NETTOVERMÖGEN</b>   |             |              | <b>355.886</b>    | <b>1,52</b>                       |
| <b>GESAMTNETTOVERMÖGEN</b>   |             |              | <b>23.415.439</b> | <b>100,00</b>                     |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Brazil Bond  
Aufstellung der Wertpapiieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Wäh-<br>rung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens | Beschreibung                                   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Wäh-<br>rung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |
|---|--------------------------|--------------|-------------------|-----------------------------------|--|--------------------------|--------------|-------------------|-----------------------------------|
| <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>  |                          |              |                   |                                   | <b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>       |                          |              |                   |                                   |
| <b>AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>               |                          |              |                   |                                   | <b>IRLAND</b>                                  |                          |              |                   |                                   |
| <b>ANLEIHEN</b>   |                          |              |                   |                                   | HSBC GLOBAL LIQUIDITY FUND                     |                          |              |                   |                                   |
| <b>BRASILIEN</b>  |                          |              |                   |                                   | 125 USD  |                          |              |                   |                                   |
| BRAZIL (GOVT) 0 %   |                          |              |                   |                                   |  |                          |              | 125               | 0,00                              |
| 01/01/2026  | 34.800                   | BRL          | 5.883.599         | 15,36                             |  |                          |              | <u>125</u>        | <u>0,00</u>                       |
| BRAZIL (GOVT) 10 %  |                          |              |                   |                                   | <b>SUMME ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b> |                          |              |                   |                                   |
| 01/01/2027  | 28.295                   | BRL          | 5.630.457         | 14,70                             |  |                          |              | <u>125</u>        | <u>0,00</u>                       |
| BRAZIL (GOVT) 10 %  |                          |              |                   |                                   | <b>SUMME WERTPAPIERANLAGEN</b>                 |                          |              |                   |                                   |
| 01/01/2029  | 27.742                   | BRL          | 5.426.595         | 14,17                             |  |                          |              | <u>37.759.333</u> | <u>98,58</u>                      |
| BRAZIL (GOVT) 10 %  |                          |              |                   |                                   | <b>SONSTIGES NETTOVERMÖGEN</b>                 |                          |              |                   |                                   |
| 01/01/2031  | 10.400                   | BRL          | 2.000.197         | 5,22                              |  |                          |              | <u>542.161</u>    | <u>1,42</u>                       |
| BRAZIL (GOVT) 10 %  |                          |              |                   |                                   | <b>GESAMTNETTOVERMÖGEN</b>                     |                          |              |                   |                                   |
| 01/01/2033  | 12.900                   | BRL          | 2.454.178         | 6,41                              |  |                          |              | <u>38.301.494</u> | <u>100,00</u>                     |
| BRAZIL LETRAS DO TESOIRO NACIONAL 0 % 01.07.2025                                | 11.700                   | BRL          | 2.077.140         | 5,42                              |  |                          |              |                   |                                   |
| BRAZIL LETRAS DO TESOIRO NACIONAL 0 % 01.07.2026                                | 38.400                   | BRL          | 6.183.385         | 16,14                             |  |                          |              |                   |                                   |
| BRAZIL LETRAS DO TESOIRO NACIONAL 0 % 01.07.2027                                | 18.200                   | BRL          | 2.642.121         | 6,90                              |  |                          |              |                   |                                   |
| BRAZIL LETRAS DO TESOIRO NACIONAL 0 % 01.01.2030                                | 2.000                    | BRL          | 222.662           | 0,58                              |  |                          |              |                   |                                   |
| BRAZIL NOTAS DO TESOIRO NACIONAL 10 % 01.01.2035                                | 1.830                    | BRL          | 343.825           | 0,90                              |  |                          |              |                   |                                   |
|   |                          |              | <u>32.864.159</u> | <u>85,80</u>                      |  |                          |              |                   |                                   |
|   |                          |              | <u>32.864.159</u> | <u>85,80</u>                      |  |                          |              |                   |                                   |
| <b>SUMME ANLEIHEN</b>   |                          |              |                   |                                   |  |                          |              |                   |                                   |
| <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTEN WERTPAPIERE WERTPAPIERE</b>     |                          |              | <b>32.864.159</b> | <b>85,80</b>                      |  |                          |              |                   |                                   |
| <b>AN EINEM ANDEREM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE, ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>    |                          |              |                   |                                   |  |                          |              |                   |                                   |
| <b>ANLEIHEN</b>   |                          |              |                   |                                   |  |                          |              |                   |                                   |
| <b>BRASILIEN</b>  |                          |              |                   |                                   |  |                          |              |                   |                                   |
| BRAZIL (GOVT) 10 %  |                          |              |                   |                                   |  |                          |              |                   |                                   |
| 01/01/2025  | 24.500                   | BRL          | 4.895.049         | 12,78                             |  |                          |              |                   |                                   |
|   |                          |              | <u>4.895.049</u>  | <u>12,78</u>                      |  |                          |              |                   |                                   |
| <b>SUMME ANLEIHEN</b>   |                          |              | <b>4.895.049</b>  | <b>12,78</b>                      |  |                          |              |                   |                                   |
| <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN MARKT GEHANDELTEN ÜBERTRAGBAREN WERTPAPIERE</b> |                          |              | <b>4.895.049</b>  | <b>12,78</b>                      |  |                          |              |                   |                                   |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Corporate Euro Bond Fixed Term 2027 (aufgelegt am 30. Juni 2023)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in EUR)

| Beschreibung  | Nennwert | Währung | Kurswert | % des Nettovermögens | Beschreibung   | Nennwert | Währung | Kurswert | % des Nettovermögens |
|---|----------|---------|----------|----------------------|--|----------|---------|----------|----------------------|
| <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>  |          |         |          |                      | <b>ARVAL SERVICE LEASE</b>                           |          |         |          |                      |
| <b>AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |          |         |          |                      | FRANCE 4,75 % 22.05.2027                             |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | 2.200.000 EUR 2.274.709 1,25                         |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | AUCHAN HOLDING 3,25 % 23.07.2027                     |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | 1.400.000 EUR 1.339.318 0,74                         |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | BANQUE STELLANTIS                                    |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | FRANCE 4 % 21.01.2027                                |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | 1.400.000 EUR 1.416.012 0,78                         |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | BNP PARIBAS 0,25 % VRN 13.04.2027                    |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | 1.400.000 EUR 1.305.505 0,72                         |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | BNP PARIBAS 2,25 % 11/01/2027                        |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | 800.000 EUR 772.579 0,43                             |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | BPCE 0,5 % 24.02.2027                                |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | 900.000 EUR 825.354 0,45                             |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | BPCE 0,5 % VRN 15.09.2027                            |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | 700.000 EUR 647.863 0,36                             |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | CREDIT AGRICOLE 2,625 % 17.03.2027                   |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | 4.200.000 EUR 4.073.155 2,24                         |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | CREDIT MUTUEL ARKEA 3,375 % 19.09.2027               |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | 1.100.000 EUR 1.099.198 0,61                         |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | ELIS 4,125 % 24.05.2027                              |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | 2.900.000 EUR 2.923.278 1,61                         |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | FAURECIA 2,375 % 15.06.2027                          |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | 1.900.000 EUR 1.796.245 0,99                         |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | GROUPAMA 6 % 23.01.2027                              |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | 1.200.000 EUR 1.273.831 0,70                         |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | ICADE 1,5 % 13.09.2027                               |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | 2.000.000 EUR 1.853.059 1,02                         |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | ILIAD 5,375 % 14.06.2027                             |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | 1.700.000 EUR 1.738.165 0,96                         |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | IMERYS 1,5 % 15.01.2027                              |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | 2.200.000 EUR 2.077.087 1,14                         |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | MUTUELLE ASSURANCE DES COMMERCIAL 0,625 % 21.06.2027 |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | 3.700.000 EUR 3.357.139 1,85                         |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | ORANO 5,375 % 15.05.2027                             |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | 4.300.000 EUR 4.480.513 2,48                         |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | RCI BANQUE 4,5 % 06/04/2027                          |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | 1.700.000 EUR 1.732.032 0,95                         |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | RCI BANQUE 4,75 % 06/07/2027                         |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | 1.420.000 EUR 1.462.045 0,81                         |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | RENAULT 2,5 % 02.06.2027                             |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | 1.600.000 EUR 1.531.410 0,84                         |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | SOCIETE GENERALE 0,75 % 25.01.2027                   |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | 2.800.000 EUR 2.585.522 1,42                         |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | SUEZ 1,875 % 24.05.2027                              |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | 600.000 EUR 570.942 0,31                             |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | TEREOS FINANCE GROUPE 4,75 % 30.04.2027              |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | 1.550.000 EUR 1.559.976 0,86                         |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | UNIBAILRODAMCOWESTFIELD 0,625 % 04.05.2027           |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | 800.000 EUR 734.293 0,40                             |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | VALEO 5,375 % 28.05.2027                             |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | 4.200.000 EUR 4.352.247 2,40                         |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | WENDEL 2,5 % 09.02.2027                              |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | 900.000 EUR 878.434 0,48                             |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | <b>53.758.722 29,62</b>                              |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | <b>DEUTSCHLAND</b>                                   |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | COMMERZBANK 0,875 % 22.01.2027                       |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | 1.400.000 EUR 1.299.421 0,72                         |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | IHO VERWALTUNGS GMBH 3,875 % 15.05.2027              |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | 1.110.000 EUR 1.090.720 0,60                         |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | SANTANDER CONSUMER BANK 4,375 % 13.09.2027           |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | 2.500.000 EUR 2.547.357 1,41                         |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | SCHAEFFLER 2,875 % 26.03.2027                        |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | 900.000 EUR 877.550 0,48                             |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | VONOVIA 0,375 % 16.06.2027                           |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | 1.700.000 EUR 1.530.821 0,84                         |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | VONOVIA 4,75 % 23.05.2027                            |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | 1.400.000 EUR 1.437.772 0,79                         |          |         |          |                      |
| <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>  |          |         |          |                      | <b>FRANCE 4,75 % 22.05.2027</b>                      |          |         |          |                      |
| <b>AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |          |         |          |                      | <b>2.200.000 EUR 2.274.709 1,25</b>                  |          |         |          |                      |
| <b>ANLEIHEN</b>   |          |         |          |                      | <b>23.07.2027</b>                                    |          |         |          |                      |
| <b>AUSTRALIEN</b>   |          |         |          |                      | <b>BANQUE STELLANTIS</b>                             |          |         |          |                      |
| AUSNET SERVICES   |          |         |          |                      | FRANCE 4 % 21.01.2027                                |          |         |          |                      |
| HOLDINGS 1,5 % 26.02.2027   |          |         |          |                      | 1.400.000 EUR 1.416.012 0,78                         |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | BNP PARIBAS 0,25 % VRN 13.04.2027                    |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | 1.400.000 EUR 1.305.505 0,72                         |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | BNP PARIBAS 2,25 % 11/01/2027                        |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | 800.000 EUR 772.579 0,43                             |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | BPCE 0,5 % 24.02.2027                                |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | 900.000 EUR 825.354 0,45                             |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | BPCE 0,5 % VRN 15.09.2027                            |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | 700.000 EUR 647.863 0,36                             |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | CREDIT AGRICOLE 2,625 % 17.03.2027                   |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | 4.200.000 EUR 4.073.155 2,24                         |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | CREDIT MUTUEL ARKEA 3,375 % 19.09.2027               |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | 1.100.000 EUR 1.099.198 0,61                         |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | ELIS 4,125 % 24.05.2027                              |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | 2.900.000 EUR 2.923.278 1,61                         |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | FAURECIA 2,375 % 15.06.2027                          |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | 1.900.000 EUR 1.796.245 0,99                         |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | GROUPAMA 6 % 23.01.2027                              |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | 1.200.000 EUR 1.273.831 0,70                         |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | ICADE 1,5 % 13.09.2027                               |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | 2.000.000 EUR 1.853.059 1,02                         |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | ILIAD 5,375 % 14.06.2027                             |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | 1.700.000 EUR 1.738.165 0,96                         |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | IMERYS 1,5 % 15.01.2027                              |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | 2.200.000 EUR 2.077.087 1,14                         |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | MUTUELLE ASSURANCE DES COMMERCIAL 0,625 % 21.06.2027 |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | 3.700.000 EUR 3.357.139 1,85                         |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | ORANO 5,375 % 15.05.2027                             |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | 4.300.000 EUR 4.480.513 2,48                         |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | RCI BANQUE 4,5 % 06/04/2027                          |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | 1.700.000 EUR 1.732.032 0,95                         |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | RCI BANQUE 4,75 % 06/07/2027                         |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | 1.420.000 EUR 1.462.045 0,81                         |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | RENAULT 2,5 % 02.06.2027                             |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | 1.600.000 EUR 1.531.410 0,84                         |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | SOCIETE GENERALE 0,75 % 25.01.2027                   |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | 2.800.000 EUR 2.585.522 1,42                         |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | SUEZ 1,875 % 24.05.2027                              |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | 600.000 EUR 570.942 0,31                             |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | TEREOS FINANCE GROUPE 4,75 % 30.04.2027              |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | 1.550.000 EUR 1.559.976 0,86                         |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | UNIBAILRODAMCOWESTFIELD 0,625 % 04.05.2027           |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | 800.000 EUR 734.293 0,40                             |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | VALEO 5,375 % 28.05.2027                             |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | 4.200.000 EUR 4.352.247 2,40                         |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | WENDEL 2,5 % 09.02.2027                              |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | 900.000 EUR 878.434 0,48                             |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | <b>53.758.722 29,62</b>                              |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | <b>DEUTSCHLAND</b>                                   |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | COMMERZBANK 0,875 % 22.01.2027                       |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | 1.400.000 EUR 1.299.421 0,72                         |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | IHO VERWALTUNGS GMBH 3,875 % 15.05.2027              |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | 1.110.000 EUR 1.090.720 0,60                         |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | SANTANDER CONSUMER BANK 4,375 % 13.09.2027           |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | 2.500.000 EUR 2.547.357 1,41                         |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | SCHAEFFLER 2,875 % 26.03.2027                        |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | 900.000 EUR 877.550 0,48                             |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | VONOVIA 0,375 % 16.06.2027                           |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | 1.700.000 EUR 1.530.821 0,84                         |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | VONOVIA 4,75 % 23.05.2027                            |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | 1.400.000 EUR 1.437.772 0,79                         |          |         |          |                      |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Corporate Euro Bond Fixed Term 2027 (aufgelegt zum 30. Juni 2023) (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in EUR)

| Beschreibung  | Nennwert  | Währung | Kurswert          | % des Nettovermögens | Beschreibung  | Nennwert  | Währung | Kurswert         | % des Nettovermögens |
|---|-----------|---------|-------------------|----------------------|---|-----------|---------|------------------|----------------------|
| ZF FINANCE GMBH 2 %<br>06/05/2027                     | 1.800.000 | EUR     | 1.678.841         | 0,92                 | <b>NIEDERLANDE</b>                                    |           |         |                  |                      |
|   |           |         | <b>10.462.482</b> | <b>5,76</b>          | ABN AMRO BANK 2,375 %<br>01/06/2027                   | 1.200.000 | EUR     | 1.164.125        | 0,64                 |
| <b>GROSSBRITANNIEN</b>                                |           |         |                   |                      | ING GROEP 1,25 % VRN<br>16.02.2027                    | 800.000   | EUR     | 763.351          | 0,42                 |
| BARCLAYS PLC 2,885 % VRN<br>31.01.2027                | 1.450.000 | EUR     | 1.428.191         | 0,79                 | LEASEPLAN 0,25 %<br>07/09/2026                        | 450.000   | EUR     | 415.162          | 0,23                 |
| HSBC HOLDINGS PLC<br>3,019 % VRN 15.06.2027           | 1.050.000 | EUR     | 1.034.513         | 0,57                 |   |           |         | <b>2.342.638</b> | <b>1,29</b>          |
| INTERNATIONAL GAME TECHNOLOGY<br>PLC 3,5 % 15.06.2026 | 1.300.000 | EUR     | 1.287.367         | 0,71                 | <b>NORWEGEN</b>                                       |           |         |                  |                      |
| LLOYDS BANK CORPORATE MARKETS<br>P 4,125 % 30.05.2027 | 1.200.000 | EUR     | 1.223.650         | 0,67                 | DNB BANK 3,625 % VRN<br>16.02.2027                    | 600.000   | EUR     | 599.616          | 0,33                 |
| NATWEST MARKETS PLC<br>1,375 % 02.03.2027             | 1.500.000 | EUR     | 1.416.141         | 0,78                 |   |           |         | <b>599.616</b>   | <b>0,33</b>          |
|   |           |         | <b>6.389.862</b>  | <b>3,52</b>          | <b>PORTUGAL</b>                                       |           |         |                  |                      |
| <b>IRLAND</b>   |           |         |                   |                      | CAIXA GERAL DE DEPOSITOS<br>0,375 % VRN 21.09.2027    | 700.000   | EUR     | 648.403          | 0,36                 |
| BANK OF IRELAND GROUP<br>0,375 % VRN 10.05.2027       | 680.000   | EUR     | 634.638           | 0,35                 | EDP ENERGIAS DE PORTUGAL<br>1,625 % 15.04.2027        | 800.000   | EUR     | 760.792          | 0,42                 |
| CA AUTO BANK 4,75 %<br>25.01.2027                     | 2.350.000 | EUR     | 2.407.858         | 1,33                 |   |           |         | <b>1.409.195</b> | <b>0,78</b>          |
| CRH SMW FINANCE 4 %<br>11/07/2027                     | 1.000.000 | EUR     | 1.018.344         | 0,56                 | <b>SPANIEN</b>  |           |         |                  |                      |
| JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL<br>0,375 % 15.09.2027  | 450.000   | EUR     | 406.663           | 0,22                 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA<br>3,375 % 20.09.2027 | 1.000.000 | EUR     | 1.000.584        | 0,55                 |
| SMURFIT KAPPA TREASURY<br>1,50 % 15.09.2027           | 1.200.000 | EUR     | 1.121.862         | 0,62                 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA<br>3,5 % 10.02.2027   | 1.400.000 | EUR     | 1.393.803        | 0,77                 |
|   |           |         | <b>5.589.365</b>  | <b>3,08</b>          | BANCO DE SABADELL<br>1,125 % VRN 11.03.2027           | 700.000   | EUR     | 667.124          | 0,37                 |
| <b>ITALIEN</b>  |           |         |                   |                      | CAIXABANK 4,625 % VRN<br>16.05.2027                   | 1.100.000 | EUR     | 1.118.255        | 0,62                 |
| ASTM 1 % 25.11.2026                                   | 700.000   | EUR     | 655.476           | 0,36                 | CELLNEX FINANCE 1 %<br>15.09.2027                     | 4.600.000 | EUR     | 4.217.543        | 2,32                 |
| AUTOSTRADA 1,75 %<br>01/02/2027                       | 2.750.000 | EUR     | 2.612.176         | 1,44                 |   |           |         | <b>8.397.309</b> | <b>4,63</b>          |
| CA AUTO BANK SPAIRELAND<br>4,375 % 08.06.2026         | 550.000   | EUR     | 556.111           | 0,31                 | <b>SCHWEDEN</b>                                       |           |         |                  |                      |
| INTESA SANPAOLO 4,375 %<br>29.08.2027                 | 1.640.000 | EUR     | 1.681.541         | 0,93                 | SKANDINAVISKA ENSKILDA<br>BANKEN 0,75 % 09.08.2027    | 1.600.000 | EUR     | 1.462.481        | 0,81                 |
| INTESA SANPAOLO 4,75 %<br>06/09/2027                  | 2.300.000 | EUR     | 2.374.108         | 1,31                 | SVENSKA HANDELSBANKEN<br>3,875 % 10.05.2027           | 700.000   | EUR     | 711.689          | 0,39                 |
| LEASYS 4,625 % 16.02.2027                             | 2.800.000 | EUR     | 2.863.735         | 1,58                 | TELEFONAKTIEBOLAGET<br>1,125 % 08.02.2027             | 1.650.000 | EUR     | 1.530.261        | 0,84                 |
| MUNDYS 1,875 % 13.07.2027                             | 4.640.000 | EUR     | 4.339.719         | 2,39                 | VERISURE HOLDING 3,25 %<br>15.02.2027                 | 1.500.000 | EUR     | 1.441.005        | 0,79                 |
| UNICREDIT 2,2 % VRN<br>22.07.2027                     | 1.250.000 | EUR     | 1.204.541         | 0,66                 |   |           |         | <b>5.145.436</b> | <b>2,83</b>          |
|   |           |         | <b>16.287.407</b> | <b>8,98</b>          | <b>SCHWEIZ</b>  |           |         |                  |                      |
| <b>LUXEMBURG</b>                                      |           |         |                   |                      | CREDIT SUISSE AGLONDON<br>5,5 % 20.08.2026            | 600.000   | EUR     | 625.765          | 0,34                 |
| CNH INDUSTRIAL FINANCE<br>EUROPE 1,75 % 25.03.2027    | 400.000   | EUR     | 381.432           | 0,21                 | CREDIT SUISSE GROUP 1 %<br>VRN 24.06.2027             | 1.900.000 | EUR     | 1.787.656        | 0,99                 |
| LOGICOR FINANCING<br>1,625 % 15.07.2027               | 2.770.000 | EUR     | 2.538.756         | 1,40                 |   |           |         | <b>2.413.421</b> | <b>1,33</b>          |
| SELP FINANCE 3,75 %<br>10/08/2027                     | 2.400.000 | EUR     | 2.388.617         | 1,32                 | <b>USA</b>  |           |         |                  |                      |
|   |           |         | <b>5.308.805</b>  | <b>2,93</b>          | AMERICAN TOWER 0,45 %<br>15.01.2027                   | 1.400.000 | EUR     | 1.285.184        | 0,71                 |
|   |           |         |                   |                      | AMERICAN TOWER 4,125 %<br>16.05.2027                  | 1.700.000 | EUR     | 1.722.894        | 0,95                 |
|   |           |         |                   |                      | BALL 1,5 % 15.03.2027                                 | 800.000   | EUR     | 750.646          | 0,41                 |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Corporate Euro Bond Fixed Term 2027 (aufgelegt zum 30. Juni 2023) (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in EUR)

| Beschreibung   | Nennwert  | Wäh-<br>rung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens | Beschreibung  | Nennwert  | Wäh-<br>rung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |
|--|-----------|--------------|--------------------|-----------------------------------|---|-----------|--------------|--------------------|-----------------------------------|
| BANK OF AMERICA 1,776 %<br>VRN 04.05.2027  | 900.000   | EUR          | 866.398            | 0,48                              | RENTOKIL INITIAL<br>FINANCE 3,875 % 27.06.2027  | 1.000.000 | EUR          | 1.011.619          | 0,56                              |
| BERRY GLOBAL 1,5 %<br>15.01.2027   | 2.560.000 | EUR          | 2.404.779          | 1,33                              |   |           |              | <b>2.897.856</b>   | <b>1,60</b>                       |
| CELANESE US HOLDINGS<br>2,125 % 01.03.2027                                       | 1.950.000 | EUR          | 1.859.767          | 1,02                              | <b>SPANIEN</b><br>SANTANDER ISSUANCES<br>3,125 % 19.01.2027                             | 1.600.000 | EUR          | 1.576.434          | 0,87                              |
| DISCOVERY COMMUNICATIONS<br>1,9 % 19.03.2027                                     | 1.100.000 | EUR          | 1.052.446          | 0,58                              |   |           |              | <b>1.576.434</b>   | <b>0,87</b>                       |
| FORD MOTOR CREDIT<br>4,867 % 03.08.2027  | 3.900.000 | EUR          | 4.020.154          | 2,22                              | <b>USA</b><br>KINDER MORGAN 2,25 %<br>16.03.2027  | 1.500.000 | EUR          | 1.440.035          | 0,79                              |
| GENERAL MOTORS<br>FINANCIAL 0,6 % 20.05.2027                                     | 2.070.000 | EUR          | 1.895.317          | 1,04                              | LEVI STRAUSS 3,375 %<br>15.03.2027  | 1.650.000 | EUR          | 1.626.196          | 0,90                              |
|  |           |              | <b>15.857.585</b>  | <b>8,74</b>                       | MANPOWERGROUP 3,5 %<br>30.06.2027   | 1.400.000 | EUR          | 1.406.239          | 0,77                              |
| <b>SUMME ANLEIHEN</b>  |           |              | <b>151.412.130</b> | <b>83,43</b>                      | NATIONAL GRID NORTH<br>AMERICA 4,151 % 12.09.2027                                       | 2.543.000 | EUR          | 2.587.536          | 1,43                              |
| <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN<br/>BÖRSE NOTIERTEN WERTPAPIERE</b>              |           |              | <b>151.412.130</b> | <b>83,43</b>                      |   |           |              | <b>7.060.006</b>   | <b>3,89</b>                       |
| <b>AN EINEM ANDEREM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE, ÜBERTRAGBARE<br/>WERTPAPIERE</b> |           |              |                    |                                   | <b>SUMME ANLEIHEN</b>   |           |              | <b>27.412.174</b>  | <b>15,10</b>                      |
|  |           |              |                    |                                   | <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN<br/>MARKT GEHANDELTEN ÜBERTRAGBAREN<br/>WERTPAPIERE</b> |           |              | <b>27.412.174</b>  | <b>15,10</b>                      |
| <b>ANLEIHEN</b>  |           |              |                    |                                   | <b>SUMME WERTPAPIERANLAGEN</b>  |           |              | <b>178.824.304</b> | <b>98,53</b>                      |
| <b>BELGIEN</b><br>BELFIUS BANK 3,125 %<br>11/05/2026                             | 900.000   | EUR          | 884.873            | 0,49                              | <b>SONSTIGES NETTOVERMÖGEN</b>  |           |              | <b>2.674.475</b>   | <b>1,47</b>                       |
|  |           |              | <b>884.873</b>     | <b>0,49</b>                       | <b>GESAMTNETTOVERMÖGEN</b>  |           |              | <b>181.498.779</b> | <b>100,00</b>                     |
| <b>FRANKREICH</b><br>BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT<br>MUTUEL 2,625 % 31.03.2027    | 4.300.000 | EUR          | 4.163.308          | 2,30                              |   |           |              |                    |                                   |
| FAURECIA 2,75 % 15.02.2027   | 1.500.000 | EUR          | 1.437.682          | 0,79                              |   |           |              |                    |                                   |
| HOLDING D'INFRASTRUCTURES DE<br>TRANSPORT 2,5 % 04.05.2027                       | 1.200.000 | EUR          | 1.164.245          | 0,64                              |   |           |              |                    |                                   |
| TDF INFRASTRUCTURE 2,5 %<br>07/04/2026   | 1.100.000 | EUR          | 1.070.880          | 0,59                              |   |           |              |                    |                                   |
|  |           |              | <b>7.836.115</b>   | <b>4,32</b>                       |   |           |              |                    |                                   |
| <b>DEUTSCHLAND</b><br>DEUTSCHE BANK 1,625 %<br>20.01.2027                        | 4.300.000 | EUR          | 4.056.179          | 2,23                              |   |           |              |                    |                                   |
|  |           |              | <b>4.056.179</b>   | <b>2,23</b>                       |   |           |              |                    |                                   |
| <b>GROSSBRITANNIEN</b><br>EC FINANCE 3 % 15.10.2026                              | 1.330.000 | EUR          | 1.294.684          | 0,71                              |   |           |              |                    |                                   |
|  |           |              | <b>1.294.684</b>   | <b>0,71</b>                       |   |           |              |                    |                                   |
| <b>ITALIEN</b><br>NEXI 1,625 % 30.04.2026  | 750.000   | EUR          | 713.367            | 0,39                              |   |           |              |                    |                                   |
|  |           |              | <b>713.367</b>     | <b>0,39</b>                       |   |           |              |                    |                                   |
| <b>JAPAN</b><br>NISSAN MOTOR 2,652 %<br>17.03.2026                               | 1.120.000 | EUR          | 1.092.660          | 0,60                              |   |           |              |                    |                                   |
|  |           |              | <b>1.092.660</b>   | <b>0,60</b>                       |   |           |              |                    |                                   |
| <b>NIEDERLANDE</b><br>DUFREY ONE 2 % 15.02.2027                                  | 2.000.000 | EUR          | 1.886.237          | 1,04                              |   |           |              |                    |                                   |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Euro Bond  
Aufstellung der Wertpapiieranlagen zum 31. März 2024  
(in EUR)

| Beschreibung  | Nennwert | Wäh-<br>rung | Kurswert | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens | Beschreibung   | Nennwert | Wäh-<br>rung | Kurswert | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |
|---|----------|--------------|----------|-----------------------------------|--|----------|--------------|----------|-----------------------------------|
| <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>  |          |              |          |                                   | FRANCE (GOVT) 0,75 %<br>25.05.2053                       |          |              |          |                                   |
| <b>AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE<br/>WERTPAPIERE</b> |          |              |          |                                   | 400.000 EUR 215.166 0,39                                 |          |              |          |                                   |
| <b>ANLEIHEN</b>   |          |              |          |                                   | FRANCE (GOVT) 4,75 %<br>25.04.2035                       |          |              |          |                                   |
| <b>AUSTRALIEN</b>   |          |              |          |                                   | 2.200.000 EUR 2.589.537 4,68                             |          |              |          |                                   |
| COMMONWEALTH BANK OF<br>AUSTRALIA 1,936 % VRN<br>03/10/2029           |          |              |          |                                   | KLEPIERRE 0,625 %<br>01/07/2030                          |          |              |          |                                   |
| 300.000 EUR 295.577 0,53  |          |              |          |                                   | 600.000 EUR 503.579 0,91                                 |          |              |          |                                   |
| <b>ÖSTERREICH</b>   |          |              |          |                                   | LA BANQUE POSTALE<br>1,375 % 24.04.2029                  |          |              |          |                                   |
| AUSTRIA (GOVT) 2,4 %<br>23.05.2034                                    |          |              |          |                                   | 200.000 EUR 180.778 0,33                                 |          |              |          |                                   |
| 850.000 EUR 819.793 1,48  |          |              |          |                                   | 500.000 EUR 465.432 0,84                                 |          |              |          |                                   |
| <b>BELGIEN</b>  |          |              |          |                                   | 26.05.2026   |          |              |          |                                   |
| BELGIUM (GOVT) 1,7 %<br>22.06.2050                                    |          |              |          |                                   | 350.000 EUR 334.318 0,60                                 |          |              |          |                                   |
| 1.100.000 EUR 796.697 1,44  |          |              |          |                                   | REGIE AUTONOME DES<br>TRANSPORTS 0,35 % 20.06.2029       |          |              |          |                                   |
| BELGIUM (GOVT) 1,90 %<br>22.06.2038                                   |          |              |          |                                   | 400.000 EUR 348.848 0,63                                 |          |              |          |                                   |
| 2.400.000 EUR 2.078.270 3,75  |          |              |          |                                   | RTE RESEAU DE TRANSPORT<br>1,125 % 08.07.2040            |          |              |          |                                   |
| BELGIUM (GOVT) 2,6 %<br>22.06.2024                                    |          |              |          |                                   | 400.000 EUR 284.007 0,51                                 |          |              |          |                                   |
| 1.500.000 EUR 1.495.794 2,70  |          |              |          |                                   | RTE RESEAU DE TRANSPORT<br>1,125 % 09.09.2049            |          |              |          |                                   |
| EUROPEAN UNION 0,125 %<br>10/06/2035                                  |          |              |          |                                   | 400.000 EUR 254.830 0,46                                 |          |              |          |                                   |
| 1.200.000 EUR 893.767 1,61  |          |              |          |                                   | SOCIETE GENERALE 0,75 %<br>25.01.2027                    |          |              |          |                                   |
| KBC GROUP 0,25 % VRN<br>01/03/2027                                    |          |              |          |                                   | 400.000 EUR 369.360 0,67                                 |          |              |          |                                   |
| 200.000 EUR 187.901 0,34  |          |              |          |                                   | TOTAL 1,625 % VRN PERP<br>29.12.2049                     |          |              |          |                                   |
| <b>KANADA</b>   |          |              |          |                                   | 418.000 EUR 378.453 0,68                                 |          |              |          |                                   |
| CANADA (GOVT) 1,875 %<br>21.05.2024                                   |          |              |          |                                   | 300.000 EUR 294.640 0,53                                 |          |              |          |                                   |
| 600.000 EUR 598.393 1,08  |          |              |          |                                   | UNIBAIL RODAMCO 2,25 %<br>14.05.2038                     |          |              |          |                                   |
| FEDERATION DES CAISSES<br>3,25 % 18.04.2028                           |          |              |          |                                   | 400.000 EUR 334.307 0,60                                 |          |              |          |                                   |
| 700.000 EUR 701.461 1,27  |          |              |          |                                   | <b>11.195.043 20,21</b>                                  |          |              |          |                                   |
| <b>DÄNEMARK</b>   |          |              |          |                                   | <b>DEUTSCHLAND</b>                                       |          |              |          |                                   |
| ORSTED 1,5 % 26.11.2029   |          |              |          |                                   | BUNDESREPUB DEUTSCHLAND<br>1,5 % 15.05.2024              |          |              |          |                                   |
| ORSTED 2,25 % 14.06.2028  |          |              |          |                                   | 1.000.000 EUR 997.438 1,80                               |          |              |          |                                   |
| 400.000 EUR 361.209 0,65  |          |              |          |                                   | 600.000 EUR 523.300 0,94                                 |          |              |          |                                   |
| 581.000 EUR 556.819 1,01  |          |              |          |                                   | DAIMLER 0,75 % 10.09.2030                                |          |              |          |                                   |
| <b>918.028 1,66</b>   |          |              |          |                                   | DEUTSCHE BOERSE 1,25 %<br>VRN 16.06.2047                 |          |              |          |                                   |
| <b>FRANKREICH</b>   |          |              |          |                                   | 200.000 EUR 187.901 0,34                                 |          |              |          |                                   |
| AGENCE FRANCAISE DE<br>DEVELOPPEMENT 0,50 %<br>31.10.2025             |          |              |          |                                   | 700.000 EUR 701.461 1,27                                 |          |              |          |                                   |
| 1.000.000 EUR 955.364 1,72  |          |              |          |                                   | EON 0,375 % 29.09.2027                                   |          |              |          |                                   |
| 500.000 EUR 497.693 0,90  |          |              |          |                                   | GERMANY (GOVT) 0 %<br>15.08.2050                         |          |              |          |                                   |
| AXA 3,941 % VRN PERP  |          |              |          |                                   | 1.650.000 EUR 883.651 1,60                               |          |              |          |                                   |
| 1.500.000 EUR 1.278.724 2,31  |          |              |          |                                   | GERMANY (GOVT) 2,5 %<br>15.08.2046                       |          |              |          |                                   |
| BNP PARIBAS 1 % 17.04.2024  |          |              |          |                                   | 600.000 EUR 602.882 1,09                                 |          |              |          |                                   |
| 300.000 EUR 599.307 1,08  |          |              |          |                                   | KREDITANSTALT FUER<br>WIEDERAUFBAU 0,875 %<br>04/07/2039 |          |              |          |                                   |
| DANONE 1 % VRN PERP   |          |              |          |                                   | 1.000.000 EUR 753.409 1,36                               |          |              |          |                                   |
| 700.000 EUR 276.096 0,50  |          |              |          |                                   | MERCCK 1,625 % VRN<br>09/09/2080                         |          |              |          |                                   |
| EDENRED 1,875 % 06.03.2026  |          |              |          |                                   | 600.000 EUR 565.569 1,02                                 |          |              |          |                                   |
| 400.000 EUR 355.382 0,64  |          |              |          |                                   | TALANX 2,25 % VRN<br>05/12/2047                          |          |              |          |                                   |
| <b>GROSSBRITANNIEN</b>  |          |              |          |                                   | 300.000 EUR 279.878 0,51                                 |          |              |          |                                   |
| BP CAPITAL MARKETS<br>3,625 % VRN PERP                                |          |              |          |                                   | <b>5.426.926 9,80</b>                                    |          |              |          |                                   |
| 250.000 EUR 239.016 0,43  |          |              |          |                                   | <b>GROSSBRITANNIEN</b>                                   |          |              |          |                                   |
| NATIONAL GRID 0,75 %<br>01/09/2033                                    |          |              |          |                                   | BP CAPITAL MARKETS<br>3,625 % VRN PERP                   |          |              |          |                                   |
| 600.000 EUR 461.208 0,83  |          |              |          |                                   | 250.000 EUR 239.016 0,43                                 |          |              |          |                                   |
| <b>700.224 1,26</b>   |          |              |          |                                   | NATIONAL GRID 0,75 %<br>01/09/2033                       |          |              |          |                                   |
|   |          |              |          |                                   | 600.000 EUR 461.208 0,83                                 |          |              |          |                                   |
|   |          |              |          |                                   | <b>700.224 1,26</b>                                      |          |              |          |                                   |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Euro Bond (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in EUR)

| Beschreibung  | Nennwert  | Wäh-<br>rung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens | Beschreibung   | Nennwert  | Wäh-<br>rung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |
|---|-----------|--------------|-------------------|-----------------------------------|--|-----------|--------------|------------------|-----------------------------------|
| <b>IRLAND</b>   |           |              |                   |                                   | <b>NORWEGEN</b>  |           |              |                  |                                   |
| LINDE 3,375 % 12.06.2029                                  | 800.000   | EUR          | 809.932           | 1,46                              | DNB BOLIGKREDITT 0,625 %<br>19.06.2025                           | 400.000   | EUR          | 386.813          | 0,70                              |
|   |           |              | <b>809.932</b>    | <b>1,46</b>                       | TELENOR 1,125 % 31.05.2029                                       | 550.000   | EUR          | 496.825          | 0,90                              |
| <b>ITALIEN</b>  |           |              |                   |                                   | <b>SPANIEN</b>   |           |              |                  |                                   |
| ASSICURAZIONI GENERALI<br>5,5 % VRN 27.10.2047            | 500.000   | EUR          | 521.761           | 0,94                              | RED ELECTRICA FINANCIACIONES<br>3 % 17.01.2034                   | 1.000.000 | EUR          | 987.729          | 1,78                              |
| INTESA SANPAOLO 0,75 %<br>04/12/2024                      | 1.000.000 | EUR          | 980.026           | 1,77                              | SPAIN (GOVT) 1,4 %<br>30.04.2028                                 | 500.000   | EUR          | 473.166          | 0,85                              |
| ITALY (GOVT) 1,35 %<br>01/04/2030                         | 1.000.000 | EUR          | 896.912           | 1,62                              | SPAIN (GOVT) 1,85 %<br>30.07.2035                                | 1.050.000 | EUR          | 915.205          | 1,65                              |
| ITALY (GOVT) 1,6 %<br>01/06/2026                          | 700.000   | EUR          | 677.348           | 1,22                              | SPAIN (GOVT) 1,95 %<br>30.04.2026                                | 1.000.000 | EUR          | 979.095          | 1,77                              |
| ITALY (GOVT) 2,8 %<br>01/12/2028                          | 3.000.000 | EUR          | 2.957.166         | 5,34                              | SPAIN (GOVT) 2,9 %<br>31.10.2046                                 | 750.000   | EUR          | 668.992          | 1,21                              |
| ITALY (GOVT) 2,95 %<br>01/09/2038                         | 400.000   | EUR          | 358.646           | 0,65                              | SPAIN (GOVT) 4,9 %<br>30.07.2040                                 | 600.000   | EUR          | 702.387          | 1,27                              |
| ITALY (GOVT) 4,5 %<br>01/03/2026                          | 500.000   | EUR          | 511.685           | 0,92                              |  |           |              | <b>4.726.574</b> | <b>8,53</b>                       |
| ITALY (GOVT) 5 %<br>01/09/2040                            | 950.000   | EUR          | 1.061.918         | 1,92                              | <b>USA</b>   |           |              |                  |                                   |
| ITALY (GOVT) 6 %<br>01/05/2031                            | 850.000   | EUR          | 993.338           | 1,79                              | COLGATEPALMOLIVE 0,875 %<br>12/11/2039                           | 400.000   | EUR          | 284.235          | 0,51                              |
| ITALY (GOVT) 6,5 %<br>01/11/2027                          | 500.000   | EUR          | 557.302           | 1,01                              | INTERNATIONAL BANK FOR<br>RECONSTRUCTION 0,25 %<br>10/01/2050    | 300.000   | EUR          | 154.568          | 0,28                              |
| UNICREDIT 4 % 05.03.2034                                  | 807.000   | EUR          | 818.812           | 1,48                              | INTL BANK FOR RECON<br>AND DEV 0,5 % 16.04.2030                  | 500.000   | EUR          | 439.435          | 0,79                              |
|   |           |              | <b>10.334.914</b> | <b>18,66</b>                      |  |           |              | <b>878.238</b>   | <b>1,58</b>                       |
| <b>LUXEMBURG</b>  |           |              |                   |                                   | <b>SUMME ANLEIHEN</b>  |           |              |                  |                                   |
| EUROPEAN INVESTMENT<br>BANK 0,01 % 15.11.2035             | 700.000   | EUR          | 507.018           | 0,92                              | <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN</b>                              |           |              |                  |                                   |
| EUROPEAN INVESTMENT<br>BANK 1 % 14.03.2031                | 500.000   | EUR          | 447.535           | 0,81                              | <b>BÖRSE NOTIERTEN WERTPAPIERE</b>                               |           |              |                  |                                   |
| EUROPEAN INVESTMENT<br>BANK 4 % 15.04.2030                | 540.000   | EUR          | 579.835           | 1,05                              | <b>WERTPAPIERE</b>   |           |              |                  |                                   |
| LUXEMBOURG (GOVT) 0 %<br>28.04.2030                       | 1.400.000 | EUR          | 1.191.139         | 2,14                              | <b>AN EINEM ANDEREM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE, ÜBERTRAGBARE</b> |           |              |                  |                                   |
|   |           |              | <b>2.725.527</b>  | <b>4,92</b>                       | <b>WERTPAPIERE</b>   |           |              |                  |                                   |
| <b>NIEDERLANDE</b>  |           |              |                   |                                   | <b>ANLEIHEN</b>  |           |              |                  |                                   |
| ASR NEDERLAND 5.125 VRN<br>29.09.2045                     | 300.000   | EUR          | 303.800           | 0,55                              | <b>BELGIEN</b>   |           |              |                  |                                   |
| ING GROEP FRN 1 %<br>13.11.2030                           | 600.000   | EUR          | 569.703           | 1,03                              | BELGIUM (GOVT) 1 %<br>22.06.2031                                 |           |              |                  |                                   |
| NETHERLANDS (GOVT) 4 %<br>15.01.2037                      | 850.000   | EUR          | 973.446           | 1,76                              |  |           |              |                  |                                   |
| SIEMENS<br>FINANCIERINGSMAATSCHAPPIJ<br>N 1 % 25.02.2030  | 300.000   | EUR          | 267.622           | 0,48                              | <b>KANADA</b>  |           |              |                  |                                   |
| SIEMENS<br>FINANCIERINGSMAATSCHAPPIJ<br>1,25 % 28.02.2031 | 200.000   | EUR          | 178.661           | 0,32                              | CPPIB CAPITAL 0,25 %<br>18.01.2041                               |           |              |                  |                                   |
| SWISS LIFE 4,5 % VRN PERP                                 | 600.000   | EUR          | 601.132           | 1,09                              | CPPIB CAPITAL 0,875 %<br>06/02/2029                              |           |              |                  |                                   |
|   |           |              | <b>2.894.364</b>  | <b>5,23</b>                       |  |           |              |                  |                                   |
|   |           |              |                   |                                   | <b>1.113.908,00</b>  |           |              |                  |                                   |
|   |           |              |                   |                                   | <b>2,02</b>  |           |              |                  |                                   |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



## Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Euro Bond (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in EUR)

| Beschreibung   | Nennwert  | Wäh-<br>rung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |
|--|-----------|--------------|-------------------|-----------------------------------|
| <b>IRLAND</b>  |           |              |                   |                                   |
| ZURICH FINANCE IRELAND<br>1,875 % VRN 17.09.2050                                     | 200.000   | EUR          | 176.012           | 0,32                              |
|  |           |              | <b>176.012</b>    | <b>0,32</b>                       |
| <b>LUXEMBURG</b>   |           |              |                   |                                   |
| EUROPEAN INVESTMENT<br>BANK 0,125 % 15.04.2025                                       | 1.100.000 | EUR          | 1.064.994         | 1,92                              |
| EUROPEAN STABILITY<br>MECHANISM 0,75 %<br>05/09/2028                                 | 500.000   | EUR          | 459.498           | 0,83                              |
|  |           |              | <b>1.524.492</b>  | <b>2,75</b>                       |
| <b>NIEDERLANDE</b>   |           |              |                   |                                   |
| IBERDROLA INTERNATIONAL<br>1,45 % VRN PERP   | 300.000   | EUR          | 276.188           | 0,50                              |
| IBERDROLA INTERNATIONAL<br>2,25 % VRN PERP   | 600.000   | EUR          | 538.329           | 0,97                              |
| SWISS REINSURANCE 2,6 %<br>VRN PERP  | 600.000   | EUR          | 583.763           | 1,05                              |
|  |           |              | <b>1.398.280</b>  | <b>2,52</b>                       |
| <b>SPANIEN</b>   |           |              |                   |                                   |
| BANCO BILBAO VIZCAYA<br>ARGENTARIA 0,75 %<br>04/06/2025                              | 200.000   | EUR          | 193.472           | 0,35                              |
| IBERDROLA FINANZAS 1 %<br>07/03/2025   | 300.000   | EUR          | 292.628           | 0,53                              |
|  |           |              | <b>486.100</b>    | <b>0,88</b>                       |
| <b>SUMME ANLEIHEN</b>  |           |              | <b>5.010.596</b>  | <b>9,05</b>                       |
| <b>SUMME DER AN EINER GEREGELTEN<br/>MARKT GEHANDELTEN ÜBERTRAGBAREN WERTPAPIERE</b> |           |              | <b>5.010.596</b>  | <b>9,05</b>                       |
| <b>SUMME WERTPAPIERANLAGEN</b>   |           |              | <b>54.371.657</b> | <b>98,16</b>                      |
| <b>SONSTIGES NETTOVERMÖGEN</b>   |           |              | <b>1.016.935</b>  | <b>1,84</b>                       |
| <b>GESAMTNETTOVERMÖGEN</b>   |           |              | <b>55.388.592</b> | <b>100,00</b>                     |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Euro Bond Total Return  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in EUR)

| Beschreibung   | Nennwert  | Währung | Kurswert         | % des Nettovermögens | Beschreibung  | Nennwert  | Währung | Kurswert          | % des Nettovermögens |
|--|-----------|---------|------------------|----------------------|---|-----------|---------|-------------------|----------------------|
| <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>   |           |         |                  |                      | <b>AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |           |         |                   |                      |
| <b>ANLEIHEN</b>  |           |         |                  |                      | <b>ÖSTERREICH</b>   |           |         |                   |                      |
| A1 TOWERS HOLDING 5,25 %<br>13.07.2028                             | 1.000.000 | EUR     | 1.053.982        | 1,13                 | BANQUE FEDERATIVE DU<br>CREDIT MUTUEL 4,375 %<br>11/01/2034       | 1.000.000 | EUR     | 994.432           | 1,07                 |
| ERSTE GROUP BANK 0,875 %<br>VRN 15.11.2032                         | 1.200.000 | EUR     | 1.064.911        | 1,14                 | CREDIT AGRICOLE 1,625 %<br>VRN 05.06.2030                         | 1.000.000 | EUR     | 969.138           | 1,04                 |
| RAIFFEISEN BANK<br>INTERNATIONAL 1,375 % VRN<br>17.06.2033         | 1.000.000 | EUR     | 833.351          | 0,90                 | CREDIT AGRICOLE 6,5 %<br>VRN PERP                                 | 1.000.000 | EUR     | 1.017.193         | 1,09                 |
| VIENNA INSURANCE GROUP<br>3,75 % VRN 02.03.2046                    | 1.000.000 | EUR     | 995.784          | 1,07                 | CREDIT AGRICOLE<br>ASSURANCES 4,5 % VRN                           | 600.000   | EUR     | 601.186           | 0,65                 |
|  |           |         | <b>3.948.028</b> | <b>4,24</b>          | PERP CREDIT MUTUEL ARKEA<br>1,875 % VRN 25.10.2029                | 1.000.000 | EUR     | 984.931           | 1,06                 |
| <b>BELGIEN</b>   |           |         |                  |                      | <b>CROWN EUROPEAN HOLDINGS<br/>4,75 % 15.03.2029</b>              |           |         |                   |                      |
| ELIA GROUP 5,85 % VRN PERP<br>EUROPEAN UNION 2,625 %<br>04/02/2048 | 2.000.000 | EUR     | 2.063.217        | 2,22                 | ELECTRICITE DE FRANCE<br>4,75 % 12.10.2034                        | 1.000.000 | EUR     | 1.074.266         | 1,15                 |
| EUROPEAN UNION 2,75 %<br>05/10/2026                                | 1.000.000 | EUR     | 911.686          | 0,98                 | ELIS 3,75 % 21.03.2030  | 400.000   | EUR     | 398.980           | 0,43                 |
|  |           |         | 4.982.086        | 5,35                 | LA POSTE 3,125 % VRN PERP   | 1.000.000 | EUR     | 973.392           | 1,05                 |
|  |           |         | <b>7.956.989</b> | <b>8,55</b>          | NEXANS 4,25 % 11.03.2030  | 500.000   | EUR     | 504.071           | 0,54                 |
| <b>KANADA</b>  |           |         |                  |                      | <b>ORANO 4 % 12.03.2031</b>                                       |           |         |                   |                      |
| ALIMENTATION COUCHE<br>3,647 % 12.05.2031                          | 1.000.000 | EUR     | 1.004.135        | 1,08                 | RCI BANQUE 2,625 % VRN<br>18.02.2030                              | 1.400.000 | EUR     | 1.370.150         | 1,47                 |
|  |           |         | <b>1.004.135</b> | <b>1,08</b>          | RTE RESEAU DE TRANSPORT<br>3,75 % 04.07.2035                      | 1.000.000 | EUR     | 1.029.055         | 1,11                 |
| <b>DÄNEMARK</b>  |           |         |                  |                      | <b>SCHNEIDER ELECTRIC<br/>3,25 % 10.10.2035</b>                   |           |         |                   |                      |
| JYSKE BANK 5,125 % VRN<br>01/05/2035                               | 1.100.000 | EUR     | 1.124.987        | 1,21                 | TOTAL 2,625 % VRN<br>29.12.2049                                   | 2.000.000 | EUR     | 1.964.269         | 2,10                 |
| TDC NET 6,5 % 01.06.2031   | 1.500.000 | EUR     | 1.621.598        | 1,74                 |   |           |         | <b>18.133.228</b> | <b>19,48</b>         |
|  |           |         | <b>2.746.585</b> | <b>2,95</b>          | <b>DEUTSCHLAND</b>  |           |         |                   |                      |
| <b>FINNLAND</b>  |           |         |                  |                      | ALLIANZ 2,6 % VRN PERP  |           |         |                   |                      |
| HUHTAMAKI 5,125 %<br>24.11.2028                                    | 500.000   | EUR     | 518.763          | 0,56                 | ALLIANZ 2,625 % VRN PERP  | 1.000.000 | EUR     | 768.340           | 0,83                 |
| SAMPO 2,5 % VRN 03.09.2052   | 1.000.000 | EUR     | 868.102          | 0,93                 | COMMERZBANK 1,375 % VRN<br>29.12.2031                             | 1.500.000 | EUR     | 1.369.851         | 1,47                 |
| SAMPO 3,375 % VRN<br>23.05.2049                                    | 1.000.000 | EUR     | 951.542          | 1,02                 | DEUTSCHE BOERSE 2 % VRN<br>23.06.2048                             | 2.000.000 | EUR     | 1.844.308         | 1,97                 |
| TEOLLISUUDEN VOIMA<br>4,75 % 01.06.2030                            | 1.000.000 | EUR     | 1.044.242        | 1,12                 | MERCK KGAA 1,625 % VRN<br>25.06.2079                              | 1.400.000 | EUR     | 1.375.773         | 1,48                 |
|  |           |         | <b>3.382.649</b> | <b>3,63</b>          |   |           |         | <b>6.147.083</b>  | <b>6,60</b>          |
| <b>FRANKREICH</b>  |           |         |                  |                      | <b>GROSSBRITANNIEN</b>  |           |         |                   |                      |
| ACCOR 3,875 % 11.03.2031   | 600.000   | EUR     | 605.643          | 0,65                 | HSBC HOLDINGS 4,599 %<br>VRN 22.03.2035                           | 495.000   | EUR     | 499.721           | 0,54                 |
| ALD 4 % 24.01.2031   | 500.000   | EUR     | 508.058          | 0,55                 | NGG FINANCE PLC 1,625 %<br>VRN 05.12.2079                         | 1.000.000 | EUR     | 982.165           | 1,05                 |
| ALD 4,375 % 23.11.2026   | 1.000.000 | EUR     | 1.013.361        | 1,09                 |   |           |         | <b>1.481.886</b>  | <b>1,59</b>          |
| BANQUE FEDERATIVE DU<br>CREDIT MUTUEL 3,875 % VRN<br>16.06.2032    | 1.500.000 | EUR     | 1.484.830        | 1,59                 | <b>IRLAND</b>   |           |         |                   |                      |
|  |           |         |                  |                      | AIB GROUP 1,875 % VRN<br>19.11.2029                               | 1.400.000 | EUR     | 1.375.524         | 1,48                 |
|  |           |         |                  |                      | AIB GROUP 2,875 % VRN<br>30.05.2031                               | 1.000.000 | EUR     | 966.243           | 1,04                 |
|  |           |         |                  |                      | BANK OF IRELAND 6,75 %<br>VRN 01.03.2033                          | 1.300.000 | EUR     | 1.391.867         | 1,49                 |
|  |           |         |                  |                      |   |           |         | <b>3.733.634</b>  | <b>4,01</b>          |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Euro Bond Total Return (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in EUR)

| Beschreibung  | Nennwert  | Währung | Kurswert         | % des Nettovermögens | Beschreibung  | Nennwert  | Währung | Kurswert          | % des Nettovermögens |
|---|-----------|---------|------------------|----------------------|---|-----------|---------|-------------------|----------------------|
| <b>ITALIEN</b>  |           |         |                  |                      | <b>USA</b>  |           |         |                   |                      |
| ENEL 4,75 % VRN PERP<br>30.05.2024                              | 1.950.000 | EUR     | 1.938.902        | 2,08                 | ATT 4,3 % 18.11.2034  | 1.500.000 | EUR     | 1.586.179         | 1,71                 |
| ITALY (GOVT) 1,75 %<br>30.05.2024                               | 2.000.000 | EUR     | 1.993.211        | 2,14                 | JPMORGAN CHASE 3,761 %<br>VRN 21.03.2034  | 706.000   | EUR     | 716.008           | 0,77                 |
| MUNDYS 4,75 % 24.01.2029  | 672.000   | EUR     | 685.286          | 0,74                 | TOYOTA MOTOR CREDIT<br>3,85 % 24.07.2030  | 1.000.000 | EUR     | 1.028.067         | 1,10                 |
| UNICREDIT 4 % 05.03.2034  | 1.210.000 | EUR     | 1.227.711        | 1,32                 |   |           |         | <u>3.330.254</u>  | <u>3,58</u>          |
|   |           |         | <u>5.845.110</u> | <u>6,28</u>          |   |           |         | <u>78.713.686</u> | <u>84,55</u>         |
| <b>LUXEMBURG</b>  |           |         |                  |                      | <b>SUMME ANLEIHEN</b>   |           |         |                   |                      |
| EUROCLEAR INVESTMENTS<br>2,625 % VRN 11.04.2048                 | 1.000.000 | EUR     | 938.018          | 1,01                 | <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN<br/>BÖRSE NOTIERTEN WERTPAPIERE</b>                 |           |         |                   |                      |
|   |           |         | <u>938.018</u>   | <u>1,01</u>          |   |           |         | <u>78.713.686</u> | <u>84,55</u>         |
| <b>NIEDERLANDE</b>  |           |         |                  |                      | <b>WERTPAPIERE</b>  |           |         |                   |                      |
| ALLIANDER 1,625 % VRN PERP<br>ASR NEDERLAND 6,625 %<br>VRN PERP | 1.000.000 | EUR     | 968.291          | 1,04                 | <b>AN EINEM ANDEREM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE, ÜBERTRAGBARE<br/>WERTPAPIERE</b>    |           |         |                   |                      |
| COOPERATIEVE RABOBANK<br>4,875 % VRN PERP                       | 943.000   | EUR     | 944.495          | 1,01                 | <b>ANLEIHEN</b>   |           |         |                   |                      |
| GAS NATURAL FENOSA<br>FINANCE 3,375 % VRN PERP                  | 1.000.000 | EUR     | 943.633          | 1,01                 | <b>FRANKREICH</b>   |           |         |                   |                      |
| NN GROUP 4,5 % VRN PERP   | 1.367.000 | EUR     | 1.000.341        | 1,07                 | BNP PARIBAS CARDIF<br>4,032 % VRN PERP  |           |         |                   |                      |
| PLUXEE 3,5 % 04.09.2028   | 800.000   | EUR     | 1.371.328        | 1,48                 |   | 1.900.000 | EUR     | 1.884.753         | 2,03                 |
| UNIVERSAL MUSIC GROUP<br>4 % 13.06.2031                         | 1.000.000 | EUR     | 800.932          | 0,86                 |   |           |         | <u>1.884.753</u>  | <u>2,03</u>          |
|   |           |         | <u>1.035.290</u> | <u>1,12</u>          | <b>DEUTSCHLAND</b>  |           |         |                   |                      |
|   |           |         | <u>7.064.310</u> | <u>7,59</u>          | DEUTSCHE BANK 4,5 % VRN<br>PERP   |           |         |                   |                      |
|   |           |         |                  |                      |   | 1.000.000 | EUR     | 864.029           | 0,93                 |
| <b>NEUSEELAND</b>   |           |         |                  |                      |   |           |         | <u>864.029</u>    | <u>0,93</u>          |
| NEW ZEALAND (GOVT) 3,5 %<br>14.04.2033                          | 4.500.000 | NZD     | 2.301.886        | 2,47                 | <b>NIEDERLANDE</b>  |           |         |                   |                      |
|   |           |         | <u>2.301.886</u> | <u>2,47</u>          | ING GROEP 2,125 % VRN<br>26.05.2031   |           |         |                   |                      |
|   |           |         |                  |                      |   | 1.000.000 | EUR     | 960.442           | 1,03                 |
| <b>NORWEGEN</b>   |           |         |                  |                      |   |           |         | <u>960.442</u>    | <u>1,03</u>          |
| DNB BANK 5 % VRN<br>13.09.2033                                  | 1.000.000 | EUR     | 1.032.055        | 1,11                 | <b>PORTUGAL</b>   |           |         |                   |                      |
|   |           |         | <u>1.032.055</u> | <u>1,11</u>          | EDP ENERGIAS DE<br>PORTUGAL 1,875 % VRN<br>14.03.2082                               |           |         |                   |                      |
|   |           |         |                  |                      |   | 2.000.000 | EUR     | 1.724.966         | 1,85                 |
| <b>SPANIEN</b>  |           |         |                  |                      |   |           |         | <u>1.724.966</u>  | <u>1,85</u>          |
| BANCO BILBAO VIZCAYA<br>ARGENTARIA 6 % VRN PERP                 | 1.000.000 | EUR     | 1.000.049        | 1,07                 | <b>SUMME ANLEIHEN</b>   |           |         |                   |                      |
| BANCO DE SABADELL 6 %<br>VRN 16.08.2033                         | 1.200.000 | EUR     | 1.240.747        | 1,33                 | <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN<br/>MARKT GEHANDELTEN ÜBERTRAGBAREN WERTPAPIERE</b> |           |         |                   |                      |
| BANCO SANTANDER 5,75 %<br>VRN 23.08.2033                        | 1.100.000 | EUR     | 1.156.921        | 1,24                 |   |           |         | <u>5.434.190</u>  | <u>5,84</u>          |
| BANKINTER 1,25 % VRN<br>23.12.2032                              | 1.100.000 | EUR     | 995.734          | 1,07                 | <b>SUMME WERTPAPIERANLAGEN</b>  |           |         |                   |                      |
| CAIXABANK 6,125 % VRN<br>30.05.2034                             | 1.300.000 | EUR     | 1.382.282        | 1,49                 |   |           |         | <u>84.147.876</u> | <u>90,39</u>         |
|   |           |         | <u>5.775.733</u> | <u>6,20</u>          | <b>SONSTIGES NETTOVERMÖGEN</b>  |           |         |                   |                      |
|   |           |         |                  |                      |   |           |         | <u>8.947.976</u>  | <u>9,61</u>          |
| <b>SCHWEDEN</b>   |           |         |                  |                      |   |           |         | <u>93.095.852</u> | <u>100,00</u>        |
| EPIROC 3,625 % 28.02.2031                                       | 1.000.000 | EUR     | 1.004.576        | 1,08                 | <b>GESAMTNETTOVERMÖGEN</b>  |           |         |                   |                      |
| NORDEA BANK 0,625 % VRN<br>18.08.2031                           | 1.500.000 | EUR     | 1.389.390        | 1,49                 |   |           |         |                   |                      |
| SKANDINAVISKA ENSKILDA<br>BANKEN 5 % VRN 17.08.2033             | 1.452.000 | EUR     | 1.498.137        | 1,61                 |   |           |         |                   |                      |
|   |           |         | <u>3.892.103</u> | <u>4,18</u>          |   |           |         |                   |                      |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Euro Credit Bond

Aufstellung der Wertpapiieranlagen zum 31. März 2024

(in EUR)

| Beschreibung  | Nennwert  | Währung | Kurswert          | % des Nettovermögens | Beschreibung   | Nennwert | Währung | Kurswert | % des Nettovermögens |
|---|-----------|---------|-------------------|----------------------|--|----------|---------|----------|----------------------|
| <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>  |           |         |                   |                      | <b>BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL 3,875 % VRN 16.06.2032</b> |          |         |          |                      |
| <b>AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |           |         |                   |                      | 4.000.000 EUR 3.959.547 0,93                                     |          |         |          |                      |
| <b>ANLEIHEN</b>   |           |         |                   |                      | <b>BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL 4,375 % 11.01.2034</b>     |          |         |          |                      |
| <b>ÖSTERREICH</b>   |           |         |                   |                      | 4.000.000 EUR 3.977.728 0,94                                     |          |         |          |                      |
| A1 TOWERS HOLDING 5,25 %  |           |         |                   |                      | <b>BNP PARIBAS 0,875 % VRN 31.08.33</b>                          |          |         |          |                      |
| 13.07.28  | 4.000.000 | EUR     | 4.215.927         | 0,99                 | 5.400.000 EUR 4.689.065 1,10                                     |          |         |          |                      |
| ERSTE GROUP BANK 0,875 %  |           |         |                   |                      | <b>BNP PARIBAS 4,125 % VRN 26.09.32</b>                          |          |         |          |                      |
| VRN 15.11.2032  | 4.800.000 | EUR     | 4.259.643         | 1,00                 | 4.000.000 EUR 4.170.237 0,98                                     |          |         |          |                      |
| RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL                                     |           |         |                   |                      | <b>BOUYGUES 4,625 % 07/06/2032</b>                               |          |         |          |                      |
| 1,375 % VRN 17.06.2033  | 3.500.000 | EUR     | 2.916.728         | 0,69                 | 3.400.000 EUR 3.688.415 0,87                                     |          |         |          |                      |
| VIENNA INSURANCE GROUP  |           |         |                   |                      | <b>BPCE 2,125 % VRN 13.10.46</b>                                 |          |         |          |                      |
| 3,75 % VRN 02.03.46   | 4.000.000 | EUR     | 3.983.138         | 0,94                 | 4.600.000 EUR 3.791.998 0,89                                     |          |         |          |                      |
|   |           |         | <b>15.375.436</b> | <b>3,62</b>          | <b>CREDIT AGRICOLE 1,625 % VRN 05.06.30</b>                      |          |         |          |                      |
| <b>BELGIEN</b>  |           |         |                   |                      | 5.000.000 EUR 4.845.688 1,14                                     |          |         |          |                      |
| ELIA GROUP 5,85 % VRN PERP  | 3.000.000 | EUR     | 3.094.826         | 0,73                 | <b>CREDIT AGRICOLE 3,875 % 20.04.31</b>                          |          |         |          |                      |
| ELIA TRANSMISSION   |           |         |                   |                      | 4.700.000 EUR 4.852.719 1,14                                     |          |         |          |                      |
| BELGIUM 3,75 % 16.01.2036   | 4.000.000 | EUR     | 4.048.926         | 0,95                 | <b>CREDIT AGRICOLE ASSURANCES 4,5 % VRN PERP</b>                 |          |         |          |                      |
| EUROPEAN UNION 2,625 %  |           |         |                   |                      | 1.100.000 EUR 1.102.174 0,26                                     |          |         |          |                      |
| 04/02/2048  | 2.000.000 | EUR     | 1.823.373         | 0,43                 | <b>CREDIT MUTUEL ARKEA 1,875 % VRN 25.10.29</b>                  |          |         |          |                      |
| EUROPEAN UNION 2,75 %   |           |         |                   |                      | 4.000.000 EUR 3.939.725 0,93                                     |          |         |          |                      |
| 05/10/2026  | 9.000.000 | EUR     | 8.967.753         | 2,11                 | <b>ELECTRICITE DE FRANCE 4,75 % 12.10.2034</b>                   |          |         |          |                      |
| FLUVIUS SYSTEM OPERATOR   |           |         |                   |                      | 4.000.000 EUR 4.297.064 1,01                                     |          |         |          |                      |
| 3,875 % 09.05.33  | 4.000.000 | EUR     | 4.088.474         | 0,96                 | 1.800.000 EUR 1.795.412 0,42                                     |          |         |          |                      |
| PROXIMUS SADP 3,75 %  |           |         |                   |                      | 4.800.000 EUR 4.930.235 1,16                                     |          |         |          |                      |
| 27.03.34  | 4.000.000 | EUR     | 4.037.141         | 0,95                 | 4.800.000 EUR 4.930.235 1,16                                     |          |         |          |                      |
|   |           |         | <b>26.060.493</b> | <b>6,13</b>          | <b>INDIGO GROUP 4,5 % 18.04.30</b>                               |          |         |          |                      |
| <b>KANADA</b>   |           |         |                   |                      | 3.000.000 EUR 3.052.941 0,72                                     |          |         |          |                      |
| ALIMENTATION COUCHE   |           |         |                   |                      | 6.000.000 EUR 6.144.599 1,45                                     |          |         |          |                      |
| 3,647 % 12.05.31  | 4.500.000 | EUR     | 4.518.609         | 1,06                 | <b>LVMH MOET HENNESSY 3,5 % 07/09/2033</b>                       |          |         |          |                      |
|   |           |         | <b>4.518.609</b>  | <b>1,06</b>          | 4.400.000 EUR 4.545.484 1,07                                     |          |         |          |                      |
| <b>DÄNEMARK</b>   |           |         |                   |                      | <b>LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON 3,25 % 07.09.2029</b>        |          |         |          |                      |
| JYSKE BANK 5,125 % VRN  |           |         |                   |                      | 3.000.000 EUR 3.036.627 0,71                                     |          |         |          |                      |
| 01/05/2035  | 4.000.000 | EUR     | 4.090.861         | 0,96                 | 5.000.000 EUR 5.025.503 1,18                                     |          |         |          |                      |
|   |           |         | <b>4.090.861</b>  | <b>0,96</b>          | <b>ORANO 4 % 12.03.31</b>  |          |         |          |                      |
| <b>FINNLAND</b>   |           |         |                   |                      | 4.000.000 EUR 3.914.714 0,92                                     |          |         |          |                      |
| SAMPO 3,375 % VRN   |           |         |                   |                      | <b>RTE RESEAU DE TRANSPORT 3,75 % 04.07.35</b>                   |          |         |          |                      |
| 23.05.49  | 5.000.000 | EUR     | 4.757.712         | 1,12                 | 6.000.000 EUR 6.174.330 1,45                                     |          |         |          |                      |
| TEOLLISUUDEN VOIMA  |           |         |                   |                      | <b>SCHNEIDER ELECTRIC 3,25 % 10.10.35</b>                        |          |         |          |                      |
| 4,75 % 01.06.30   | 4.400.000 | EUR     | 4.594.664         | 1,08                 | 5.200.000 EUR 5.211.576 1,23                                     |          |         |          |                      |
|   |           |         | <b>9.352.376</b>  | <b>2,20</b>          | 4.400.000 EUR 4.099.485 0,96                                     |          |         |          |                      |
| <b>FRANKREICH</b>   |           |         |                   |                      | <b>TOTAL 2,625 % VRN 29.12.49</b>                                |          |         |          |                      |
| ACCOR 3,875 % 11.03.31  | 2.400.000 | EUR     | 2.422.573         | 0,57                 | 9.000.000 EUR 8.839.210 2,08                                     |          |         |          |                      |
| AIR LIQUIDE FINANCE   |           |         |                   |                      | <b>122.194.418</b>   |          |         |          |                      |
| 1,375 % 02.04.30  | 4.000.000 | EUR     | 3.642.639         | 0,86                 | <b>28,75</b>   |          |         |          |                      |
| ALD 4 % 24.01.31  | 2.500.000 | EUR     | 2.540.290         | 0,60                 | <b>DEUTSCHLAND</b>   |          |         |          |                      |
| ALD 4,375 % 23.11.26  | 3.100.000 | EUR     | 3.141.418         | 0,74                 | <b>ALLIANZ 2,6 % VRN PERP</b>                                    |          |         |          |                      |
| AUTOROUTES DU SUD DE  |           |         |                   |                      | 5.000.000 EUR 3.841.700 0,90                                     |          |         |          |                      |
| LA FRANCE 3,25 % 19.01.2033                                       | 5.800.000 | EUR     | 5.783.808         | 1,36                 | <b>COMMERZBANK 1,375 % VRN 29.12.31</b>                          |          |         |          |                      |
|   |           |         |                   |                      | 5.000.000 EUR 4.566.169 1,07                                     |          |         |          |                      |
|   |           |         |                   |                      | <b>DEUTSCHE BAHN FINANCE 4 % 23.11.43</b>                        |          |         |          |                      |
|   |           |         |                   |                      | 3.000.000 EUR 3.216.806 0,76                                     |          |         |          |                      |
|   |           |         |                   |                      | <b>DEUTSCHE BANK 3,75 % VRN 15.01.30</b>                         |          |         |          |                      |
|   |           |         |                   |                      | 3.000.000 EUR 3.007.238 0,71                                     |          |         |          |                      |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Euro Credit Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapiieranlagen zum 31. März 2024

(in EUR)

| Beschreibung  | Nennwert   | Währung | Kurswert          | % des Nettovermögens | Beschreibung   | Nennwert  | Währung | Kurswert           | % des Nettovermögens |
|---|------------|---------|-------------------|----------------------|--|-----------|---------|--------------------|----------------------|
| DEUTSCHE BOERSE 2 % VRN<br>23.06.48                             | 4.400.000  | EUR     | 4.057.478         | 0,95                 | UNIVERSAL MUSIC GROUP<br>4 % 13.06.31  | 4.400.000 | EUR     | 4.555.276          | 1,07                 |
| MERCK KGAA 1,625 % VRN<br>25.06.79                              | 4.400.000  | EUR     | 4.323.858         | 1,02                 | WOLTERS KLUWER 0,75 %<br>03/07/2030  | 5.000.000 | EUR     | 4.316.009          | 1,02                 |
|   |            |         | <b>23.013.249</b> | <b>5,41</b>          |  |           |         | <b>45.953.393</b>  | <b>10,81</b>         |
| <b>GROSSBRITANNIEN</b>  |            |         |                   |                      | <b>NORWEGEN</b>  |           |         |                    |                      |
| HSBC HOLDINGS 4,599 %<br>VRN 22.03.35                           | 2.121.000  | EUR     | 2.141.230         | 0,50                 | DNB BANK 5 % VRN<br>13.09.33   | 4.400.000 | EUR     | 4.541.043          | 1,07                 |
| SSE PLC 4 % 05.09.2031  | 4.400.000  | EUR     | 4.555.909         | 1,07                 |  |           |         | <b>4.541.043</b>   | <b>1,07</b>          |
|   |            |         | <b>6.697.139</b>  | <b>1,57</b>          | <b>SPANIEN</b>   |           |         |                    |                      |
| <b>IRLAND</b>   |            |         |                   |                      | BANCO SANTANDER 5 % VRN<br>22.04.34  | 4.200.000 | EUR     | 4.288.675          | 1,01                 |
| AIB GROUP 1,875 % VRN<br>19.11.29                               | 5.000.000  | EUR     | 4.912.586         | 1,16                 | BANKINTER 1,25 % VRN<br>23.12.32   | 4.400.000 | EUR     | 3.982.934          | 0,94                 |
| BANK OF IRELAND 1,375 %<br>VRN 11.08.31                         | 3.000.000  | EUR     | 2.808.496         | 0,66                 | CAIXABANK 6,125 % VRN<br>30.05.34  | 5.000.000 | EUR     | 5.316.469          | 1,25                 |
| ESB FINANCE 4 % 03.05.2032                                      | 5.358.000  | EUR     | 5.561.576         | 1,31                 | INMOBILIARIA COLONIAL<br>2,5 % 28.11.29  | 5.000.000 | EUR     | 4.734.931          | 1,11                 |
|   |            |         | <b>13.282.658</b> | <b>3,13</b>          |  |           |         | <b>18.323.009</b>  | <b>4,31</b>          |
| <b>ITALIEN</b>  |            |         |                   |                      | <b>SCHWEDEN</b>  |           |         |                    |                      |
| 2I RETE GAS 4,375 %<br>06/06/2033                               | 3.000.000  | EUR     | 3.074.521         | 0,72                 | EPIROC 3,625 % 28.02.31  | 4.000.000 | EUR     | 4.018.304          | 0,95                 |
| ENEL 3,375 % VRN<br>24.11.81                                    | 3.600.000  | EUR     | 3.494.220         | 0,82                 | NORDEA BANK 0,625 % VRN<br>18.08.31  | 6.000.000 | EUR     | 5.557.561          | 1,31                 |
| ENEL 4,75 % VRN PERP<br>ITALY (GOVT) 1,75 %<br>30.05.24         | 14.000.000 | EUR     | 13.952.468        | 3,28                 | SKANDINAVISKA ENSKILDA<br>BANKEN 5 % VRN 17.08.2033                              | 4.755.000 | EUR     | 4.906.089          | 1,15                 |
| MUNDYS 4,75 % 24.01.29  | 2.690.000  | EUR     | 2.743.185         | 0,65                 |  |           |         | <b>14.481.954</b>  | <b>3,41</b>          |
| UNICREDIT 4 % 05.03.2034  | 5.646.000  | EUR     | 5.728.641         | 1,35                 | <b>USA</b>   |           |         |                    |                      |
|   |            |         | <b>32.721.694</b> | <b>7,70</b>          | ATT 4,3 % 18.11.34   | 5.000.000 | EUR     | 5.287.264          | 1,24                 |
| <b>LUXEMBURG</b>  |            |         |                   |                      | JPMORGAN CHASE 3,761 %<br>VRN 21.03.34   | 3.294.000 | EUR     | 3.340.693          | 0,79                 |
| EUROCLEAR INVESTMENTS<br>2,625 % VRN 11.04.48                   | 4.000.000  | EUR     | 3.752.074         | 0,88                 | NATIONAL GRID NORTH<br>AMERICA 0,41 % 20.01.2026                                 | 4.000.000 | EUR     | 3.771.021          | 0,89                 |
| NESTLE FINANCE<br>INTERNATIONAL 3,75 % 14.11.2035               | 3.100.000  | EUR     | 3.261.171         | 0,77                 | PROCTER GAMBLE 3,25 %<br>02/08/2031  | 4.400.000 | EUR     | 4.491.014          | 1,06                 |
|   |            |         | <b>7.013.245</b>  | <b>1,65</b>          | TOYOTA MOTOR CREDIT<br>3,85 % 24.07.30   | 5.000.000 | EUR     | 5.140.336          | 1,21                 |
| <b>NIEDERLANDE</b>  |            |         |                   |                      | VERIZON COMMUNICATIONS<br>3,75 % 28.02.36  | 5.000.000 | EUR     | 5.030.388          | 1,18                 |
| ALLIANDER 1,625 % VRN PERP<br>ASR NEDERLAND 6,625 %<br>VRN PERP | 4.400.000  | EUR     | 4.260.480         | 1,00                 |  |           |         | <b>27.060.716</b>  | <b>6,37</b>          |
| COOPERATIEVE RABOBANK<br>3,1 % VRN PERP                         | 5.000.000  | EUR     | 4.347.748         | 1,02                 | <b>SUMME ANLEIHEN</b>  |           |         | <b>374.680.293</b> | <b>88,15</b>         |
| GAS NATURAL FENOSA<br>FINANCE 3,375 % VRN PERP                  | 4.000.000  | EUR     | 4.001.364         | 0,94                 | <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN<br/>BÖRSE NOTIERTEN WERTPAPIERE</b>              |           |         |                    |                      |
| GENERALI FINANCE 4,596 %<br>VRN PERP                            | 1.800.000  | EUR     | 1.808.397         | 0,43                 | <b>WERTPAPIERE</b>   |           |         |                    |                      |
| NN GROUP 4,5 % VRN PERP<br>PLUXEE 3,5 % 04.09.28                | 3.633.000  | EUR     | 3.644.502         | 0,86                 | <b>AN EINEM ANDEREM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE, ÜBERTRAGBARE<br/>WERTPAPIERE</b> |           |         |                    |                      |
| SIEMENS<br>FINANCIERINGSMAATSCHAPP<br>3,625 % 24.02.43          | 2.200.000  | EUR     | 2.231.110         | 0,52                 | <b>ANLEIHEN</b>  |           |         |                    |                      |
| SIEMENS<br>FINANCIERINGSMAATSCHAPPIJ<br>3,5 % 24.02.36          | 4.000.000  | EUR     | 4.078.220         | 0,96                 | <b>BELGIEN</b>   |           |         |                    |                      |
| UNILEVER FINANCE NETHER-<br>LANDS 3,5 % 23.02.35                | 3.550.000  | EUR     | 3.641.032         | 0,86                 | EUROPEAN UNION 3 %<br>04/12/2034   | 5.000.000 | EUR     | 5.043.394          | 1,19                 |
|   |            |         |                   |                      |  |           |         | <b>5.043.394</b>   | <b>1,19</b>          |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Euro Credit Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in EUR)

| Beschreibung                                       | Nennwert  | Währung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|-----------|---------|--------------------|------------------------------|
| <b>FRANKREICH</b>                                  |           |         |                    |                              |
| BNP PARIBAS CARDIF                                 |           |         |                    |                              |
| 4,032 % VRN PERP                                   | 4.400.000 | EUR     | 4.364.693          | 1,03                         |
| THALES 4,25 % 18.10.31                             | 4.000.000 | EUR     | 4.224.299          | 0,99                         |
|  |           |         | <b>8.588.992</b>   | <b>2,02</b>                  |
| <b>DEUTSCHLAND</b>                                 |           |         |                    |                              |
| WPP FINANCE DEUTSCHLAND                            |           |         |                    |                              |
| 1,625 % 23.03.30                                   | 4.000.000 | EUR     | 3.566.718          | 0,84                         |
|  |           |         | <b>3.566.718</b>   | <b>0,84</b>                  |
| <b>NIEDERLANDE</b>                                 |           |         |                    |                              |
| ABB FINANCE 3,375 %                                |           |         |                    |                              |
| 15.01.34   | 3.000.000 | EUR     | 3.017.154          | 0,71                         |
| FERROVIAL 4,375 %                                  |           |         |                    |                              |
| 13.09.30   | 4.000.000 | EUR     | 4.169.244          | 0,99                         |
| ING GROEP 2,125 % VRN                              |           |         |                    |                              |
| 26.05.31   | 4.000.000 | EUR     | 3.841.770          | 0,90                         |
|  |           |         | <b>11.028.168</b>  | <b>2,60</b>                  |
| <b>USA</b>   |           |         |                    |                              |
| VERALTO 4,15 % 19.09.2031                          | 4.400.000 | EUR     | 4.526.417          | 1,06                         |
|  |           |         | <b>4.526.417</b>   | <b>1,06</b>                  |
| <b>SUMME ANLEIHEN</b>                              |           |         | <b>32.753.689</b>  | <b>7,71</b>                  |
| <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN</b>                |           |         |                    |                              |
| <b>MARKT GEHANDELTEN ÜBERTRAGBAREN WERTPAPIERE</b> |           |         | <b>32.753.689</b>  | <b>7,71</b>                  |
| <b>GELDMARKTINSTRUMENTE</b>                        |           |         |                    |                              |
| <b>SCHATZWECHSEL</b>                               |           |         |                    |                              |
| <b>FRANKREICH</b>                                  |           |         |                    |                              |
| FRANCE (GOVT) 0 %                                  |           |         |                    |                              |
| 05/06/2024   | 8.000.000 | EUR     | 7.947.272          | 1,87                         |
|  |           |         | <b>7.947.272</b>   | <b>1,87</b>                  |
| <b>SUMME SCHATZWECHSEL</b>                         |           |         | <b>7.947.272</b>   | <b>1,87</b>                  |
| <b>GELDMARKTINSTRUMENTE GESAMT</b>                 |           |         | <b>7.947.272</b>   | <b>1,87</b>                  |
| <b>SUMME WERTPAPIERANLAGEN</b>                     |           |         | <b>415.381.254</b> | <b>97,73</b>                 |
| <b>SONSTIGES NETTOVERMÖGEN</b>                     |           |         | <b>9.659.358</b>   | <b>2,27</b>                  |
| <b>GESAMTNETTOVERMÖGEN</b>                         |           |         | <b>425.040.612</b> | <b>100,00</b>                |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Euro High Yield Bond

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in EUR)

| Beschreibung  | Nennwert | Währung | Kurswert | % des Nettovermögens | Beschreibung                   | Nennwert | Währung | Kurswert | % des Nettovermögens |
|---|----------|---------|----------|----------------------|--------------------------------|----------|---------|----------|----------------------|
| <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>  |          |         |          |                      | <b>LA BANQUE POSTALE</b>       |          |         |          |                      |
| <b>AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |          |         |          |                      | 3,875 % VRN PERP               |          |         |          |                      |
| <b>ANLEIHEN</b>   |          |         |          |                      | 12.000.000 EUR 11.039.028 1,46 |          |         |          |                      |
| <b>ÖSTERREICH</b>   |          |         |          |                      | LA BANQUE POSTALE 5,5 %        |          |         |          |                      |
| ERSTE GROUP BANK 4,25 %   |          |         |          |                      | VRN 05.03.34                   |          |         |          |                      |
| VRN PERP  |          |         |          |                      | 3.000.000 EUR 3.150.854 0,42   |          |         |          |                      |
| 12.200.000 EUR 11.021.369 1,46                                    |          |         |          |                      | LA POSTE 3,125 % VRN PERP      |          |         |          |                      |
| <b>BELGIEN</b>  |          |         |          |                      | 16.500.000 EUR 16.060.960 2,13 |          |         |          |                      |
| AGEAS 1,875 % VRN   |          |         |          |                      | NEXANS 4,25 % 11.03.30         |          |         |          |                      |
| 24.11.51  |          |         |          |                      | 3.800.000 EUR 3.830.941 0,51   |          |         |          |                      |
| 6.900.000 EUR 5.691.822 0,75                                      |          |         |          |                      | ORANGE 5 % VRN PERP            |          |         |          |                      |
| <b>BELFIUS BANK 3,625 % VRN</b>                                   |          |         |          |                      | 16.150.000 EUR 16.499.077 2,19 |          |         |          |                      |
| PERP  |          |         |          |                      | ORANO 4 % 12.03.31             |          |         |          |                      |
| 7.400.000 EUR 6.895.793 0,91                                      |          |         |          |                      | 4.200.000 EUR 4.221.423 0,56   |          |         |          |                      |
| 3.900.000 EUR 4.023.274 0,53                                      |          |         |          |                      | RCI BANQUE 2,625 % VRN         |          |         |          |                      |
| 16.200.000 EUR 15.480.910 2,06                                    |          |         |          |                      | 18.02.30                       |          |         |          |                      |
| 2.700.000 EUR 2.694.303 0,36                                      |          |         |          |                      | 16.500.000 EUR 16.148.195 2,14 |          |         |          |                      |
| <b>34.786.102 4,61</b>  |          |         |          |                      | REXEL 5,25 % 15.09.30          |          |         |          |                      |
| <b>DÄNEMARK</b>   |          |         |          |                      | 1.773.000 EUR 1.840.546 0,24   |          |         |          |                      |
| ORSTED 1,5 % VRN  |          |         |          |                      | TDF INFRASTRUCTURE             |          |         |          |                      |
| 18.02.21  |          |         |          |                      | 5,625 % 21.07.28               |          |         |          |                      |
| 3.900.000 EUR 3.106.138 0,41                                      |          |         |          |                      | TDF INFRASTRUCTURE SASU        |          |         |          |                      |
| ORSTED 5,125 % VRN  |          |         |          |                      | 1,75 % 01.12.29                |          |         |          |                      |
| 14.03.24  |          |         |          |                      | 5.600.000 EUR 4.953.144 0,66   |          |         |          |                      |
| 2.436.000 EUR 2.453.052 0,33                                      |          |         |          |                      | TEREOS FINANCE GROUPE          |          |         |          |                      |
| <b>5.559.190 0,74</b>   |          |         |          |                      | 7,25 % 15.04.28                |          |         |          |                      |
| <b>FINNLAND</b>   |          |         |          |                      | TOTAL 1,75 % VRN PERP          |          |         |          |                      |
| HUHTAMAKI 4,25 %  |          |         |          |                      | 24.500.000 EUR 24.500.001 3,25 |          |         |          |                      |
| 09/06/2027  |          |         |          |                      | UNIBAIL RODAMCO 2,875 %        |          |         |          |                      |
| 2.400.000 EUR 2.418.586 0,32                                      |          |         |          |                      | VRN PERP                       |          |         |          |                      |
| 24.11.28  |          |         |          |                      | 3.100.000 EUR 2.943.602 0,39   |          |         |          |                      |
| 3.200.000 EUR 3.320.080 0,44                                      |          |         |          |                      | UNIBAIL RODAMCO WEST-          |          |         |          |                      |
| <b>SAMPO 3,375 % VRN</b>  |          |         |          |                      | FIELD 4,125 % 11.12.30         |          |         |          |                      |
| 23.05.49  |          |         |          |                      | 7.000.000 EUR 6.660.796 0,89   |          |         |          |                      |
| 7.000.000 EUR 6.660.796 0,89                                      |          |         |          |                      | UNIBAIL RODAMCO WEST-          |          |         |          |                      |
| TEOLLISUUDEN VOIMA  |          |         |          |                      | FIELD 7,25 % VRN PERP          |          |         |          |                      |
| 2,625 % 31.03.27  |          |         |          |                      | 7.100.000 EUR 7.545.270 1,00   |          |         |          |                      |
| <b>14.139.889 1,88</b>  |          |         |          |                      | VEOLIA ENVIRONNEMENT 2 %       |          |         |          |                      |
| <b>FRANKREICH</b>   |          |         |          |                      | VRN PERP                       |          |         |          |                      |
| ARKEMA 2,75 % VRN PERP  |          |         |          |                      | 7.800.000 EUR 7.058.866 0,94   |          |         |          |                      |
| 12.200.000 EUR 12.144.049 1,61                                    |          |         |          |                      | VEOLIA ENVIRONNEMENT           |          |         |          |                      |
| 14.300.000 EUR 14.234.011 1,89                                    |          |         |          |                      | 2,5 % VRN PERP                 |          |         |          |                      |
| 6.000.000 EUR 5.814.825 0,77                                      |          |         |          |                      | 27.700.000 EUR 24.954.546 3,31 |          |         |          |                      |
| 5.000.000 EUR 4.978.501 0,66                                      |          |         |          |                      | VERALLIA 1,875 %               |          |         |          |                      |
| 7.500.000 EUR 7.624.350 1,01                                      |          |         |          |                      | 10/11/2031                     |          |         |          |                      |
| 8.400.000 EUR 9.136.221 1,21                                      |          |         |          |                      | <b>234.362.204 31,08</b>       |          |         |          |                      |
| 1.572.000 EUR 1.628.687 0,22                                      |          |         |          |                      | <b>DEUTSCHLAND</b>             |          |         |          |                      |
| 8.400.000 EUR 8.379.384 1,11                                      |          |         |          |                      | COMMERZBANK 1,375 % VRN        |          |         |          |                      |
| 9.400.000 EUR 9.611.031 1,27                                      |          |         |          |                      | 29.12.31                       |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | 7.200.000 EUR 6.575.283 0,87   |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | DEUTSCHE BOERSE 1,25 %         |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | VRN 16.06.47                   |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | 2.200.000 EUR 2.020.955 0,27   |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | DEUTSCHE BOERSE 2 % VRN        |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | 23.06.48                       |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | 1.400.000 EUR 1.291.016 0,17   |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | IHO VERWALTUNGS GMBH           |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | 3,75 % 15.09.26                |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | 4.899.842 EUR 4.842.478 0,64   |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | MERCK 1,625 % VRN              |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | 09/09/2080                     |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | 8.700.000 EUR 8.200.757 1,09   |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | MERCK KGAA 1,625 % VRN         |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | 25.06.79                       |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | 2.900.000 EUR 2.849.816 0,38   |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | NIDDA HEALTHCARE               |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | HOLDING 7,5 % 21.08.2026       |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | 2.500.000 EUR 2.581.797 0,34   |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | TUI 5,875 % 15.03.29           |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | 2.300.000 EUR 2.338.825 0,31   |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | <b>30.700.927 4,07</b>         |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | <b>GROSSBRITANNIEN</b>         |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | VODAFONE GROUP 2,625 %         |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | VRN 27.08.80                   |          |         |          |                      |
|   |          |         |          |                      | 14.100.000 EUR 13.551.896 1,80 |          |         |          |                      |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Euro High Yield Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in EUR)

| Beschreibung                                  | Nennwert   | Währung | Kurswert          | % des Nettovermögens | Beschreibung  | Nennwert   | Währung | Kurswert           | % des Nettovermögens |
|---|------------|---------|-------------------|----------------------|---|------------|---------|--------------------|----------------------|
| VODAFONE GROUP 3 % VRN<br>27.08.80            | 3.400.000  | EUR     | 3.084.654         | 0,41                 | TENNET HOLDING 2,374 %<br>VRN PERP  | 7.400.000  | EUR     | 7.196.916          | 0,95                 |
|   |            |         | <b>16.636.550</b> | <b>2,21</b>          |   |            |         | <b>66.376.548</b>  | <b>8,80</b>          |
| <b>GRIECHENLAND</b>                           |            |         |                   |                      | <b>PORTUGAL</b>   |            |         |                    |                      |
| NATIONAL BANK OF GREECE<br>4,5 % VRN 29.01.29 | 4.500.000  | EUR     | 4.515.961         | 0,60                 | EDP ENERGIAS DE PORTUGAL<br>1,875 % VRN 02.08.81                                    | 5.000.000  | EUR     | 4.702.141          | 0,62                 |
|   |            |         | <b>4.515.961</b>  | <b>0,60</b>          | EDP ENERGIAS DE PORTUGAL<br>5,943 % VRN 23.04.83                                    | 6.600.000  | EUR     | 6.907.673          | 0,92                 |
| <b>IRLAND</b>                                 |            |         |                   |                      |   |            |         | <b>11.609.814</b>  | <b>1,54</b>          |
| BANK OF IRELAND 6,75 %<br>VRN 01.03.33        | 5.987.000  | EUR     | 6.410.084         | 0,85                 | <b>SPANIEN</b>  |            |         |                    |                      |
| ENERGIA GROUP ROI                             |            |         |                   |                      | BANCO BILBAO VIZCAYA<br>4,875 % VRN 08.02.36  | 3.000.000  | EUR     | 3.027.430          | 0,40                 |
| FINANCECO 6,875 % 31.07.2028                  | 2.000.000  | EUR     | 2.076.180         | 0,28                 | BANCO DE SABADELL<br>5,125 % VRN 27.06.34   | 1.900.000  | EUR     | 1.898.756          | 0,25                 |
|   |            |         | <b>8.486.264</b>  | <b>1,13</b>          | BANCO DE SABADELL 6 %<br>VRN 16.08.33   | 7.000.000  | EUR     | 7.237.691          | 0,96                 |
| <b>ITALIEN</b>                                |            |         |                   |                      | CAIXABANK 6,25 % VRN<br>23.02.33  | 9.400.000  | EUR     | 9.967.822          | 1,32                 |
| INTESA SANPAOLO 6,184 %<br>VRN 20.02.34       | 5.711.000  | EUR     | 6.079.303         | 0,80                 | CELLNEX FINANCE 2 %<br>15.09.32   | 3.100.000  | EUR     | 2.717.971          | 0,36                 |
| MUNDYS 4,75 % 24.01.29                        | 5.379.000  | EUR     | 5.485.350         | 0,73                 | CELLNEX FINANCE 2,25 %<br>12/04/2026  | 2.000.000  | EUR     | 1.944.171          | 0,26                 |
|   |            |         | <b>11.564.653</b> | <b>1,53</b>          | CELLNEX TELECOM 1,75 %<br>23.10.30  | 9.700.000  | EUR     | 8.654.607          | 1,15                 |
| <b>LUXEMBURG</b>                              |            |         |                   |                      | CELLNEX TELECOM 1,875 %<br>26.06.29   | 10.200.000 | EUR     | 9.369.261          | 1,24                 |
| EUROCLEAR INVESTMENTS<br>2,625 % VRN 11.04.48 | 9.900.000  | EUR     | 9.286.382         | 1,23                 |   |            |         | <b>44.817.709</b>  | <b>5,94</b>          |
| HOLCIM FINANCE                                |            |         |                   |                      | <b>SCHWEDEN</b>   |            |         |                    |                      |
| LUXEMBOURG 3 % VRN PERP                       | 16.000.000 | EUR     | 15.960.794        | 2,12                 | VERISURE HOLDING<br>5,25 % 15.02.29   | 3.880.000  | EUR     | 3.758.800          | 0,50                 |
| LOGICOR FINANCING                             |            |         |                   |                      | VERISURE HOLDING 7,125 %<br>01/02/2028  | 1.800.000  | EUR     | 1.882.296          | 0,25                 |
| 4,625 % 25.07.28                              | 3.786.000  | EUR     | 3.833.638         | 0,51                 |   |            |         | <b>5.641.096</b>   | <b>0,75</b>          |
| STENA INTERNATIONAL                           |            |         |                   |                      | <b>SCHWEIZ</b>  |            |         |                    |                      |
| 7,25 % 15.02.28                               | 3.839.000  | EUR     | 4.059.052         | 0,54                 | CREDIT SUISSE GROUP<br>7,75 % VRN 01.03.29  | 7.500.000  | EUR     | 8.564.604          | 1,14                 |
|   |            |         | <b>33.139.866</b> | <b>4,40</b>          |   |            |         | <b>8.564.604</b>   | <b>1,14</b>          |
| <b>NIEDERLANDE</b>                            |            |         |                   |                      | <b>USA</b>  |            |         |                    |                      |
| ASR NEDERLAND 7 % VRN<br>07/12/2043           | 2.800.000  | EUR     | 3.238.641         | 0,43                 | FORD MOTOR CREDIT 3,25 %<br>15.09.25  | 8.400.000  | EUR     | 8.311.160          | 1,09                 |
| COOPERATIEVE RABOBANK<br>3,1 % VRN PERP       | 1.600.000  | EUR     | 1.391.279         | 0,18                 | FORD MOTOR CREDIT<br>6,125 % 15.05.28   | 2.000.000  | EUR     | 2.159.166          | 0,29                 |
| COOPERATIEVE RABOBANK<br>4,875 % VRN PERP     | 3.000.000  | EUR     | 2.830.899         | 0,38                 | IQVIA 2,25 % 15.01.28   | 2.000.000  | EUR     | 1.862.151          | 0,25                 |
| CTP 4,75 % 05.02.30                           | 2.788.000  | EUR     | 2.830.152         | 0,38                 | QUINTILES IMS 2,875 %<br>15.09.25   | 2.043.000  | EUR     | 2.008.455          | 0,27                 |
| ING GROEP FRN 1 %<br>13.11.30                 | 4.100.000  | EUR     | 3.892.973         | 0,52                 | WMG ACQUISITION 2,75 %<br>15.07.28  | 5.450.000  | EUR     | 5.141.710          | 0,68                 |
| ING GROEP NV 1,625 %<br>VRN 26.09.29          | 11.400.000 | EUR     | 11.249.768        | 1,49                 |   |            |         | <b>19.482.642</b>  | <b>2,58</b>          |
| LKQ EUROPEAN HOLDINGS<br>4,125 % 01.04.28     | 7.000.000  | EUR     | 7.025.860         | 0,93                 | <b>SUMME ANLEIHEN</b>   |            |         | <b>561.405.388</b> | <b>74,46</b>         |
| LOUIS DREYFUS 1,625 %<br>28.04.28             | 4.000.000  | EUR     | 3.707.786         | 0,49                 | <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN<br/>BÖRSE NOTIERTEN WERTPAPIERE<br/>WERTPAPIERE</b> |            |         | <b>561.405.388</b> | <b>74,46</b>         |
| NATURGY FINANCE 2,374 %<br>VRN PERP           | 6.200.000  | EUR     | 5.804.369         | 0,77                 |   |            |         |                    |                      |
| NN GROUP 6,375 % VRN PERP                     | 5.806.000  | EUR     | 5.840.895         | 0,77                 |   |            |         |                    |                      |
| OI EUROPEAN GROUP 6,25 %<br>15.05.28          | 1.235.000  | EUR     | 1.290.390         | 0,17                 |   |            |         |                    |                      |
| TELEFONICA EUROPE<br>6,135 % VRN PERP         | 9.700.000  | EUR     | 10.076.620        | 1,34                 |   |            |         |                    |                      |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Euro High Yield Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in EUR)

| Beschreibung   | Nennwert   | Währung | Kurswert          | % des Nettovermögens | Beschreibung                                       | Nennwert   | Währung | Kurswert          | % des Nettovermögens |
|--|------------|---------|-------------------|----------------------|--|------------|---------|-------------------|----------------------|
| <b>AN EINEM ANDEREM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE, ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |            |         |                   |                      | <b>CONSTELLIUM 4,25 %</b>                          |            |         |                   |                      |
| <b>ANLEIHEN</b>  |            |         |                   |                      | 15.02.26   |            |         |                   |                      |
| <b>BELGIEN</b>   |            |         |                   |                      | IBERDROLA INTERNATIONAL                            |            |         |                   |                      |
| SOLVAY 2,5 % VRN PERP  | 2.500.000  | EUR     | 2.399.526         | 0,32                 | 1,45 % VRN PERP                                    | 5.400.000  | EUR     | 4.971.388         | 0,66                 |
|  |            |         | <b>2.399.526</b>  | <b>0,32</b>          | ING GROEP 2,125 % VRN                              | 10.400.000 | EUR     | 9.988.601         | 1,32                 |
| <b>FRANKREICH</b>  |            |         |                   |                      | 26.05.31   |            |         |                   |                      |
| ABEILLE VIE 6,25 %   |            |         |                   |                      | KONINKLIJKE KPN 6 % VRN                            | 994.000    | EUR     | 1.048.267         | 0,14                 |
| 09/09/2033   | 6.400.000  | EUR     | 7.221.311         | 0,96                 | PERP   |            |         |                   |                      |
| BNP PARIBAS CARDIF   |            |         |                   |                      | PPF ARENA 3,125 %                                  | 1.900.000  | EUR     | 1.863.808         | 0,25                 |
| 4,032 % VRN PERP   | 6.300.000  | EUR     | 6.249.446         | 0,83                 | 27.03.26   |            |         |                   |                      |
| GETLINK 3,5 % 30.10.2025   | 8.400.000  | EUR     | 8.336.158         | 1,10                 | PPF TELECOM 3,25 %                                 | 6.733.000  | EUR     | 6.553.363         | 0,87                 |
| MOBILUX FINANCE 4,25 %   |            |         |                   |                      | 29.09.27   |            |         |                   |                      |
| 15.07.28   | 3.683.000  | EUR     | 3.468.254         | 0,46                 | PPF TELECOM GROUP                                  | 1.000.000  | EUR     | 983.176           | 0,13                 |
| REXEL 2,125 % 15.06.28   | 8.000.000  | EUR     | 7.448.595         | 0,99                 | 2,125 % 31.01.25                                   |            |         |                   |                      |
| TEREOS FINANCE GROUPE  |            |         |                   |                      | SWISS REINSURANCE 2,6 %                            | 2.800.000  | EUR     | 2.724.228         | 0,36                 |
| 7,5 % 30.10.25   | 1.722.000  | EUR     | 1.753.145         | 0,23                 | VRN PERP   |            |         |                   |                      |
|  |            |         | <b>34.476.909</b> | <b>4,57</b>          | TENNET HOLDING 2,995 %                             | 22.750.000 | EUR     | 22.686.749        | 3,01                 |
|  |            |         |                   |                      | PERPETUAL  |            |         | <b>62.147.768</b> | <b>8,24</b>          |
| <b>DEUTSCHLAND</b>   |            |         |                   |                      | <b>SCHWEDEN</b>                                    |            |         |                   |                      |
| COMMERZBANK 4,25 % VRN   |            |         |                   |                      | HEIMSTADEN BOSTAD 3 %                              |            |         |                   |                      |
| PERP   | 12.400.000 | EUR     | 10.783.247        | 1,44                 | VRN PERP   | 7.947.000  | EUR     | 4.749.342         | 0,63                 |
| DEUTSCHE BANK 1,375 %  |            |         |                   |                      | HEIMSTADEN BOSTAD AB                               |            |         |                   |                      |
| VRN 17.02.32   | 9.600.000  | EUR     | 8.071.732         | 1,07                 | 3,248 % VRN PERP                                   | 5.875.000  | EUR     | 4.299.081         | 0,57                 |
| DEUTSCHE BANK 1,75 % VRN   |            |         |                   |                      | SAMHALLSBYGGNADSBOLAGET                            |            |         |                   |                      |
| 19.11.30   | 3.500.000  | EUR     | 3.084.721         | 0,41                 | I NORDEN 2,875 % VRN PERP                          | 8.200.000  | EUR     | 2.000.551         | 0,27                 |
| DEUTSCHE BANK 4,5 % VRN  |            |         |                   |                      |  |            |         | <b>11.048.974</b> | <b>1,47</b>          |
| PERP   | 7.000.000  | EUR     | 6.048.201         | 0,80                 | <b>USA</b>   |            |         |                   |                      |
| DEUTSCHE BANK 4,625 %  |            |         |                   |                      | IQVIA 2,25 % 15.03.29                              | 2.900.000  | EUR     | 2.616.202         | 0,35                 |
| VRN PERP   | 3.400.000  | EUR     | 2.899.378         | 0,38                 | LEVI STRAUSS 3,375 %                               |            |         |                   |                      |
| DEUTSCHE BANK 6 %  |            |         |                   |                      | 15.03.27   | 4.150.000  | EUR     | 4.090.130         | 0,54                 |
| VRN PERP   | 4.200.000  | USD     | 3.601.715         | 0,48                 |  |            |         | <b>6.706.332</b>  | <b>0,89</b>          |
| TECHEM VERWALTUNGSGE-  |            |         |                   |                      | <b>SUMME ANLEIHEN</b>                              |            |         |                   |                      |
| SELLSCHAFT 6 % 30.07.2026  | 1.500.000  | EUR     | 1.319.021         | 0,17                 | <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN</b>                |            |         |                   |                      |
|  |            |         | <b>35.808.015</b> | <b>4,75</b>          | <b>MARKT GEHANDELTEN ÜBERTRAGBAREN WERTPAPIERE</b> |            |         |                   |                      |
| <b>GROSSBRITANNIEN</b>   |            |         |                   |                      | <b>176.533.440</b>                                 |            |         |                   |                      |
| DRAX FINCO 2,625 %   |            |         |                   |                      | <b>23,41</b>                                       |            |         |                   |                      |
| 01/11/2025   | 5.000.000  | EUR     | 4.865.036         | 0,65                 | <b>SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>           |            |         |                   |                      |
| EC FINANCE 3 % 15.10.2026  | 13.000.000 | EUR     | 12.654.807        | 1,67                 | <b>ANLEIHEN</b>                                    |            |         |                   |                      |
|  |            |         | <b>17.519.843</b> | <b>2,32</b>          | <b>NIEDERLANDE</b>                                 |            |         |                   |                      |
| <b>LUXEMBURG</b>   |            |         |                   |                      | ASR NEDERLAND 4,625 %                              |            |         |                   |                      |
| BK LC LUX 5,25 %   |            |         |                   |                      | VRN PERP   | 3.500.000  | EUR     | 3.279.197         | 0,43                 |
| 30.04.29   | 1.500.000  | EUR     | 1.513.185         | 0,20                 |  |            |         | <b>3.279.197</b>  | <b>0,43</b>          |
| GRAND CITY PROPERTIES  |            |         |                   |                      | <b>SUMME ANLEIHEN</b>                              |            |         |                   |                      |
| 1,5 % VRN PERP   | 7.600.000  | EUR     | 4.912.888         | 0,65                 | <b>SUMME SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>     |            |         |                   |                      |
|  |            |         | <b>6.426.073</b>  | <b>0,85</b>          | <b>3.279.197</b>                                   |            |         |                   |                      |
| <b>NIEDERLANDE</b>   |            |         |                   |                      | <b>741.218.025</b>                                 |            |         |                   |                      |
| ASHLAND SERVICES 2 %   |            |         |                   |                      | <b>98,30</b>                                       |            |         |                   |                      |
| 30.01.28   | 5.800.000  | EUR     | 5.333.632         | 0,71                 | <b>SUMME WERTPAPIERANLAGEN</b>                     |            |         |                   |                      |
|  |            |         |                   |                      | <b>12.845.203</b>                                  |            |         |                   |                      |
|  |            |         |                   |                      | <b>SONSTIGES NETTOVERMÖGEN</b>                     |            |         |                   |                      |
|  |            |         |                   |                      | <b>1,70</b>  |            |         |                   |                      |
|  |            |         |                   |                      | <b>GESAMTNETTOVERMÖGEN</b>                         |            |         |                   |                      |
|  |            |         |                   |                      | <b>754.063.228</b>                                 |            |         |                   |                      |
|  |            |         |                   |                      | <b>100,00</b>                                      |            |         |                   |                      |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

ESG Short Duration Credit Bond

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert       | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|----------------|------------------------------|--|--------------------------|---------|----------|------------------------------|
| <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>  |                          |         |                |                              | <b>MONDELEZ INTERNATIONAL</b>  |                          |         |          |                              |
| <b>AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |                          |         |                |                              | 1,625 % 08.03.27   |                          |         |          |                              |
| <b>ANLEIHEN</b>   |                          |         |                |                              | MORGAN STANLEY 5 %   |                          |         |          |                              |
| <b>KANADA</b>   |                          |         |                |                              | 24.11.25   |                          |         |          |                              |
| NOVA CHEMICALS 8,5 %  |                          |         |                |                              | MORGAN STANLEY 6,296 %   |                          |         |          |                              |
| 15.11.28  |                          |         |                |                              | VRN 18.10.28   |                          |         |          |                              |
|   | 75.000                   | USD     | 79.941         | 1,08                         | SEAGATE 4,75 % 01.01.2025  |                          |         |          |                              |
|   |                          |         | <b>79.941</b>  | <b>1,08</b>                  | SEAGATE 4,875 % 01.06.27   |                          |         |          |                              |
| <b>FRANKREICH</b>   |                          |         |                |                              | TRI POINTE GROUP 5,25 %  |                          |         |          |                              |
| SOCIETE GENERALE 4,75 %   |                          |         |                |                              | 01/06/2027   |                          |         |          |                              |
| 24.11.25  |                          |         |                |                              | UNITED RENTALS NORTH   |                          |         |          |                              |
| TDF INFRASTRUCTURE  |                          |         |                |                              | AMERICA 6 % 15.12.2029   |                          |         |          |                              |
| 5,625 % 21.07.28  |                          |         |                |                              | VENTAS REALTY 3,25 %   |                          |         |          |                              |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT  |                          |         |                |                              | 15.10.26   |                          |         |          |                              |
| 2,25 % VRN PERP   |                          |         |                |                              | VMWARE 1,4 % 15.08.26  |                          |         |          |                              |
|   | 100.000                  | EUR     | 113.832        | 1,53                         | WALGREENS BOOTS  |                          |         |          |                              |
|   | 100.000                  | EUR     | 103.080        | 1,39                         | ALLIANCE 3,45 % 01.06.2026   |                          |         |          |                              |
|   |                          |         | <b>413.094</b> | <b>5,56</b>                  | WASTE MANAGEMENT 1,15 %  |                          |         |          |                              |
| <b>GROSSBRITANNIEN</b>  |                          |         |                |                              | 15.03.28   |                          |         |          |                              |
| BARCLAYS 2,852 % VRN  |                          |         |                |                              | WESTERN GAS PARTNERS   |                          |         |          |                              |
| 07/05/2026  |                          |         |                |                              | 4,5 % 01.03.28   |                          |         |          |                              |
| LLOYDS BANKING GROUP  |                          |         |                |                              | WILLIAMS 5,3 % 15.08.2028  |                          |         |          |                              |
| 5,462 % 05.01.28  |                          |         |                |                              | WW GRAINGER 1,85 %   |                          |         |          |                              |
| VODAFONE GROUP 4,375 %  |                          |         |                |                              | 15.02.25   |                          |         |          |                              |
| 30.05.28  |                          |         |                |                              | 25.000   |                          |         |          |                              |
|   | 100.000                  | USD     | 98.738         | 1,33                         | 24.258   |                          |         |          |                              |
|   |                          |         | <b>492.919</b> | <b>6,64</b>                  | <b>1.794.183</b>   |                          |         |          |                              |
| <b>IRLAND</b>   |                          |         |                |                              | <b>2.932.792</b>   |                          |         |          |                              |
| AERCAP IRELAND CAPITAL  |                          |         |                |                              | <b>2.932.792</b>   |                          |         |          |                              |
| 6,1 % 15.01.27  |                          |         |                |                              | <b>39,52</b>   |                          |         |          |                              |
|   | 150.000                  | USD     | 152.655        | 2,06                         | <b>39,52</b>   |                          |         |          |                              |
|   |                          |         | <b>152.655</b> | <b>2,06</b>                  | <b>AN EINEM ANDEREM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE, ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |                          |         |          |                              |
| <b>USA</b>  |                          |         |                |                              | <b>ANLEIHEN</b>  |                          |         |          |                              |
| AMERICAN TOWER 1,3 %  |                          |         |                |                              | <b>AUSTRALIEN</b>  |                          |         |          |                              |
| 15.09.25  |                          |         |                |                              | FMG RESOURCES 4,5 %  |                          |         |          |                              |
| AMERICAN TOWER 1,95 %   |                          |         |                |                              | 15.09.27   |                          |         |          |                              |
| 22.05.26  |                          |         |                |                              | 88.000   |                          |         |          |                              |
| AMGEN 5,507 % 02.03.26  |                          |         |                |                              | USD  |                          |         |          |                              |
| BALL CORP 6,875 %   |                          |         |                |                              | 84.592   |                          |         |          |                              |
| 15.03.28  |                          |         |                |                              | 1,14   |                          |         |          |                              |
| BANK OF AMERICA 5,933 %   |                          |         |                |                              | MINERAL RESOURCES  |                          |         |          |                              |
| VRN 15.09.27  |                          |         |                |                              | 8,125 % 01.05.27   |                          |         |          |                              |
| BAXTER INTERNATIONAL  |                          |         |                |                              | 60.000   |                          |         |          |                              |
| 1,3 % 30.05.25  |                          |         |                |                              | USD  |                          |         |          |                              |
| CNH INDUSTRIAL CAPITAL  |                          |         |                |                              | 60.736   |                          |         |          |                              |
| 4,55 % 10.04.28   |                          |         |                |                              | <b>145.328</b>   |                          |         |          |                              |
| HCA 4,5 % 15.02.27  |                          |         |                |                              | <b>1,96</b>  |                          |         |          |                              |
| JP MORGAN CHASE AND   |                          |         |                |                              | <b>KANADA</b>  |                          |         |          |                              |
| CO 6,75 % VRN 29.08.2049  |                          |         |                |                              | CASCADES INC CASCADES  |                          |         |          |                              |
| KINDER MORGAN 4,3 %   |                          |         |                |                              | 5,125 % 15.01.26   |                          |         |          |                              |
| 01/03/2028  |                          |         |                |                              | 65.000   |                          |         |          |                              |
| LOWES 2,5 % 15.04.26  |                          |         |                |                              | USD  |                          |         |          |                              |
| LOWES COS 1,3 % 15.04.2028  |                          |         |                |                              | 64.071   |                          |         |          |                              |
|   | 50.000                   | USD     | 47.577         | 0,64                         | CLARIOS GLOBAL LP  |                          |         |          |                              |
|   | 100.000                  | USD     | 87.378         | 1,18                         | CLARIOS 6,75 % 15.05.2028  |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                |                              | 75.000   |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                |                              | USD  |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                |                              | 76.083   |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                |                              | 1,03   |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                |                              | HUBBAY MINERALS 4,5 %  |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                |                              | 01/04/2026   |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                |                              | 95.000   |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                |                              | USD  |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                |                              | 92.029   |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                |                              | 1,24   |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                |                              | NOVA CHEMICALS 9 %   |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                |                              | 15.02.30   |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                |                              | 95.000   |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                |                              | USD  |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                |                              | 36.240   |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                |                              | 0,49   |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                |                              | <b>366.639</b>   |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                |                              | <b>4,94</b>  |                          |         |          |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

ESG Short Duration Credit Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung                                     | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert       | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--------------------------|---------|----------------|------------------------------|---|--------------------------|---------|----------|------------------------------|
| <b>FRANKREICH</b>                                |                          |         |                |                              | ENCOMPASS HEALTH 4,5 %<br>01/02/2028                  |                          |         |          |                              |
| BPCE 2,045 % VRN<br>19.10.27                     | 250.000                  | USD     | 228.262        | 3,08                         | 75.000  | USD                      | 71.469  | 0,96     |                              |
| CROWN HOLDINGS 3,375 %<br>15.05.25               | 100.000                  | EUR     | 107.290        | 1,45                         | 50.000  | USD                      | 50.102  | 0,68     |                              |
|  |                          |         | <b>335.552</b> | <b>4,53</b>                  | 50.000  | USD                      | 51.413  | 0,69     |                              |
| <b>LUXEMBURG</b>                                 |                          |         |                |                              | FISERV 5,15 % 15.03.27                                |                          |         |          |                              |
| DANA FINANCING LUXEMBOURG<br>5,75 % 15.04.25     | 27.000                   | USD     | 26.936         | 0,36                         | 100.000   | USD                      | 100.352 | 1,35     |                              |
|  |                          |         | <b>26.936</b>  | <b>0,36</b>                  | GOLDMAN SACHS GROUP<br>0,855 % VRN 12.02.26           |                          |         |          |                              |
| <b>NIEDERLANDE</b>                               |                          |         |                |                              | GRAPHIC PACKAGING INTERNATIONAL<br>1,512 % 15.04.26   |                          |         |          |                              |
| NXP BV NXP FUNDING<br>2,7 % 01.05.25             | 90.000                   | USD     | 87.398         | 1,18                         | 180.000   | USD                      | 167.095 | 2,26     |                              |
| TRIVIUM PACKAGING<br>FINANCE 3,75 % 15.08.2026   | 100.000                  | EUR     | 105.022        | 1,41                         | 50.000  | USD                      | 49.878  | 0,67     |                              |
|  |                          |         | <b>192.420</b> | <b>2,59</b>                  | 100.000   | EUR                      | 103.591 | 1,40     |                              |
| <b>USA</b>                                       |                          |         |                |                              | IRON MOUNTAIN 5,25 %<br>15.03.28                      |                          |         |          |                              |
| AIR LEASE 2,875 %<br>15.01.26                    | 75.000                   | USD     | 71.794         | 0,97                         | 75.000  | USD                      | 72.661  | 0,98     |                              |
| AMERICAN AIRLINES ADVANTAGE<br>5,75 % 4.20.2029  | 75.000                   | USD     | 73.869         | 1,00                         | JPMORGAN CHASE 6,1 % VRN<br>PERP                      |                          |         |          |                              |
| ANTERO MIDSTREAM<br>PARTNERS 5,75 % 01.03.2027   | 50.000                   | USD     | 49.416         | 0,67                         | 25.000  | USD                      | 25.030  | 0,34     |                              |
| ANTERO RESOURCES 7,625 %<br>01/02/2029           | 50.000                   | USD     | 51.488         | 0,69                         | KINETIK HOLDINGS 6,625 %<br>15.12.28                  |                          |         |          |                              |
| ANTERO RESOURCES 8,375 %<br>15.07.26             | 25.000                   | USD     | 25.999         | 0,35                         | 50.000  | USD                      | 50.962  | 0,69     |                              |
| AVIATION CAPITAL GROUP<br>4,125 % 01.08.25       | 95.000                   | USD     | 92.606         | 1,25                         | 75.000  | USD                      | 76.044  | 1,02     |                              |
| AVIS BUDGET CAR RENTAL<br>5,75 % 15.07.27        | 75.000                   | USD     | 72.629         | 0,98                         | LABL 9,5 % 01.11.28                                   |                          |         |          |                              |
| BERRY GLOBAL ESCROW<br>5,625 % 15.07.27          | 75.000                   | USD     | 74.142         | 1,00                         | MACYS RETAIL HOLDINGS<br>5,875 % 01.04.29             |                          |         |          |                              |
| BROADCOM 1,95 %<br>02/15/2028                    | 85.000                   | USD     | 75.991         | 1,02                         | 50.000  | USD                      | 49.108  | 0,66     |                              |
| CCO HOLDINGS 5,125 %<br>01/05/2027               | 150.000                  | USD     | 143.243        | 1,94                         | 25.000  | USD                      | 24.366  | 0,33     |                              |
| CENTENE 4,25 % 15.12.2027                        | 50.000                   | USD     | 47.761         | 0,64                         | 38.000  | USD                      | 37.066  | 0,50     |                              |
| CHENIERE ENERGY<br>PARTNERS 4,5 % 01.10.29       | 50.000                   | USD     | 47.687         | 0,64                         | NORTONLIFELOCK 6,75 %<br>30.09.27                     |                          |         |          |                              |
| CHSCOMMUNITY HEALTH<br>SYSTEMS 8 % 15.03.2026    | 38.000                   | USD     | 37.914         | 0,51                         | OUTFRONT MEDIA CAPITAL<br>OUTFRON 5 % 15.08.2027      |                          |         |          |                              |
| CINEMARK 8,75 % 01.05.2025                       | 17.000                   | USD     | 17.077         | 0,23                         | 13.000  | USD                      | 12.511  | 0,17     |                              |
| CLARIVATE SCIENCE<br>HOLDINGS 3,875 % 07.01.2028 | 100.000                  | USD     | 92.597         | 1,25                         | PRIME SECURITY SERVICES<br>3,375 % 31.08.27           |                          |         |          |                              |
| CLEVELANDCLIFFS 5,875 %<br>01/06/2027            | 50.000                   | USD     | 50.043         | 0,67                         | 50.000  | USD                      | 46.043  | 0,62     |                              |
| DANA 5,625 % 15.06.28                            | 75.000                   | USD     | 73.444         | 0,99                         | PRIME SECURITY SERVICES<br>BORROWER 5,75 % 15.04.2026 |                          |         |          |                              |
| DELL INTERNATIONAL<br>6,02 % 15.06.26            | 15.000                   | USD     | 15.206         | 0,20                         | 25.000  | USD                      | 24.975  | 0,34     |                              |
| DELTA AIR LINES 7 %<br>01/05/2025                | 85.000                   | USD     | 86.401         | 1,16                         | ROCKET MORTGAGE 2,875 %<br>15.10.26                   |                          |         |          |                              |
| ELEVEN 0,95 % 10.02.26                           | 50.000                   | USD     | 46.234         | 0,62                         | 13.000  | USD                      | 12.027  | 0,16     |                              |
|  |                          |         |                |                              | SABINE PASS<br>LIQUEFACTION 5 % 15.03.2027            |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |                |                              | SBA COMMUNICATIONS<br>3,875 % 15.02.27                |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |                |                              | SEAGATE 8,25 % 15.12.29                               |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |                |                              | SEALED AIR 6,125 %<br>01/02/2028                      |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |                |                              | 100.000   | USD                      | 100.367 | 1,35     |                              |
|  |                          |         |                |                              | SIRIUS XM RADIO 4 %<br>15.07.28                       |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |                |                              | 25.000  | USD                      | 22.884  | 0,31     |                              |
|  |                          |         |                |                              | SPRINGLEAF FINANCE CORP<br>6,875 % 15.03.25           |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |                |                              | 13.000  | USD                      | 13.143  | 0,18     |                              |
|  |                          |         |                |                              | STANDARD INDUSTRIES<br>4,75 % 15.01.28                |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |                |                              | 100.000   | USD                      | 95.580  | 1,29     |                              |
|  |                          |         |                |                              | SUNOCO LP SUNOCO<br>FINANCE 7 % 15.09.28              |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |                |                              | 110.000   | USD                      | 112.548 | 1,52     |                              |
|  |                          |         |                |                              | TAYLOR MORRISON COMMUNITIES<br>5,875 % 15.06.27       |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |                |                              | 63.000  | USD                      | 63.098  | 0,85     |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

ESG Short Duration Credit Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|------------------|------------------------------|
| UBER TECHNOLOGIES 7,5 %<br>15.09.27   | 50.000                   | USD     | 51.247           | 0,69                         |
| VENTURE GLOBAL 8,125 %<br>01/06/2028  | 75.000                   | USD     | 76.677           | 1,03                         |
| VENTURE GLOBAL 9,5 %<br>01/02/2029  | 40.000                   | USD     | 43.219           | 0,58                         |
| WASH MULTIFAMILY ACQUISITION<br>5,75 % 15.04.26                                     | 20.000                   | USD     | 19.587           | 0,26                         |
| WR GRACE HOLDINGS<br>4,875 % 15.06.27   | 25.000                   | USD     | 23.826           | 0,32                         |
| WRKCO 4 % 15.03.28  | 150.000                  | USD     | 144.314          | 1,95                         |
|   |                          |         | <b>3.312.145</b> | <b>44,64</b>                 |
| <b>SUMME ANLEIHEN</b>   |                          |         | <b>4.379.020</b> | <b>59,02</b>                 |
| <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN<br/>MARKT GEHANDELTEN ÜBERTRAGBAREN WERTPAPIERE</b> |                          |         | <b>4.379.020</b> | <b>59,02</b>                 |
| <b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>  |                          |         |                  |                              |
| <b>IRLAND</b>   |                          |         |                  |                              |
| HSBC GLOBAL LIQUIDITY<br>FUND   | 85.622                   | USD     | 85.622           | 1,15                         |
| HSBC US DOLLAR ESG<br>LIQUIDITY FUND Y INC  | 1                        | USD     | 1                | 0,00                         |
|   |                          |         | <b>85.623</b>    | <b>1,15</b>                  |
| <b>SUMME ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>                                      |                          |         | <b>85.623</b>    | <b>1,15</b>                  |
| <b>SUMME WERTPAPIERANLAGEN</b>  |                          |         | <b>7.397.435</b> | <b>99,69</b>                 |
| <b>SONSTIGES NETTOVERMÖGEN</b>  |                          |         | <b>22.679</b>    | <b>0,31</b>                  |
| <b>GESAMTNETTOVERMÖGEN</b>  |                          |         | <b>7.420.114</b> | <b>100,00</b>                |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

GEM Debt Total Return

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung                                       | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|----------|------------------------------|--|--------------------------|---------|------------------|------------------------------|
| <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>  |                          |         |          |                              | <b>ISLAND</b>                                      |                          |         |                  |                              |
| <b>AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |                          |         |          |                              | ICELAND GOVERNMENT INTER-NATIONAL 3,5 % 21.03.2034 |                          |         |                  |                              |
|   |                          |         |          |                              |  | 140.000                  | EUR     | 154.382          | 0,42                         |
|   |                          |         |          |                              |  |                          |         | <b>154.382</b>   | <b>0,42</b>                  |
| <b>ANLEIHEN</b>   |                          |         |          |                              | <b>INDONESIEN</b>                                  |                          |         |                  |                              |
| <b>BENIN</b>  |                          |         |          |                              | INDONESIA (GOVT) 7,5 %                             |                          |         |                  |                              |
| BENIN (GOVT) 7,96 %<br>13.02.38                                   | 500.000                  | USD     | 487.999  | 1,33                         | 15.05.38   | 14.200.000.000           | IDR     | 947.373          | 2,58                         |
|   |                          |         |          |                              | INDONESIA (GOVT) 8,25 %<br>15.05.29                | 5.000.000.000            | IDR     | 338.457          | 0,92                         |
|   |                          |         |          |                              | PERTAMINA GEOTHERMAL<br>ENERGY 5,15 % 27.04.28     | 250.000                  | USD     | 249.388          | 0,68                         |
|   |                          |         |          |                              | PERUSAHAAN PERSEROAN<br>PERSERO 4 % 30.06.2050     | 400.000                  | USD     | 298.160          | 0,81                         |
|   |                          |         |          |                              |  |                          |         | <b>1.833.378</b> | <b>4,99</b>                  |
| <b>BRASILIEN</b>  |                          |         |          |                              | <b>Elfenbeinküste</b>                              |                          |         |                  |                              |
| BRAZIL (GOVT) 7,125 %<br>13.05.54                                 | 650.000                  | USD     | 656.023  | 1,78                         | IVORY COAST (GOVT)<br>7,625 % 30.01.33             | 330.000                  | USD     | 328.089          | 0,89                         |
| BRAZIL (GOVT) 10 %<br>01/01/2029                                  | 4.900                    | BRL     | 958.485  | 2,61                         | IVORY COAST (GOVT)<br>8,25 % 30.01.37              | 510.000                  | USD     | 512.481          | 1,39                         |
| BRAZIL (GOVT) 10 %<br>01/01/2033                                  | 2.300                    | BRL     | 437.567  | 1,19                         |  |                          |         | <b>840.570</b>   | <b>2,28</b>                  |
| BRF 5,75 % 21.09.50   | 350.000                  | USD     | 278.836  | 0,76                         | <b>KASACHSTAN</b>                                  |                          |         |                  |                              |
|   |                          |         |          |                              | KAZMUNAYGAS NATIONAL<br>6,375 % 24.10.48           |                          |         |                  |                              |
|   |                          |         |          |                              |  | 900.000                  | USD     | 845.369          | 2,30                         |
|   |                          |         |          |                              |  |                          |         | <b>845.369</b>   | <b>2,30</b>                  |
| <b>CHILE</b>  |                          |         |          |                              | <b>KENIA</b>                                       |                          |         |                  |                              |
| CORP NACIONAL DEL COBRE<br>5,125 % 02.02.33                       | 800.000                  | USD     | 761.094  | 2,07                         | KENYA (GOVT) 9,75 %<br>16.02.31                    | 470.000                  | USD     | 482.333          | 1,31                         |
|   |                          |         |          |                              |  |                          |         | <b>482.333</b>   | <b>1,31</b>                  |
|   |                          |         |          |                              | <b>LUXEMBURG</b>                                   |                          |         |                  |                              |
|   |                          |         |          |                              | MHP LUX 6,95 % 03.04.2026                          |                          |         |                  |                              |
|   |                          |         |          |                              |  | 500.000                  | USD     | 423.603          | 1,15                         |
|   |                          |         |          |                              |  |                          |         | <b>423.603</b>   | <b>1,15</b>                  |
| <b>CHINA</b>  |                          |         |          |                              | <b>MACAU</b>                                       |                          |         |                  |                              |
| ZHENRO PROPERTIES GROUP<br>6,63 % 07.01.26                        | 1.260.000                | USD     | 17.174   | 0,05                         | SANDS CHINA 5,125 %<br>08/08/2025                  | 250.000                  | USD     | 246.691          | 0,67                         |
|   |                          |         |          |                              |  |                          |         | <b>246.691</b>   | <b>0,67</b>                  |
| <b>KOLUMBIEN</b>  |                          |         |          |                              | <b>MALAYSIA</b>                                    |                          |         |                  |                              |
| BANCOLOMBIA 4,625 % VRN<br>18.12.29                               | 400.000                  | USD     | 390.352  | 1,06                         | KHAZANAH GLOBAL SUKUK<br>4,687 % 01.06.28          | 822.000                  | USD     | 811.409          | 2,21                         |
| COLOMBIA (GOVT) 8,75 %<br>14.11.53                                | 300.000                  | USD     | 326.551  | 0,89                         |  |                          |         | <b>811.409</b>   | <b>2,21</b>                  |
| ECOPETROL 8,375 %<br>19.01.36                                     | 150.000                  | USD     | 151.202  | 0,41                         | <b>MEXIKO</b>                                      |                          |         |                  |                              |
| ECOPETROL 8,625 %<br>19.01.29                                     | 450.000                  | USD     | 477.229  | 1,30                         | MEXICO (GOVT) 6,4 %<br>07/05/2054                  |                          |         |                  |                              |
|   |                          |         |          |                              |  | 800.000                  | USD     | 800.349          | 2,18                         |
|   |                          |         |          |                              | MEXICO (GOVT) 8,5 %<br>18.11.38                    |                          |         |                  |                              |
|   |                          |         |          |                              |  | 211.000                  | MXN     | 1.185.020        | 3,22                         |
|   |                          |         |          |                              | TRUST FIBRA 7,375 %<br>13.02.34                    |                          |         |                  |                              |
|   |                          |         |          |                              |  | 400.000                  | USD     | 399.513          | 1,09                         |
|   |                          |         |          |                              |  |                          |         | <b>2.384.882</b> | <b>6,49</b>                  |
| <b>GROSSBRITANNIEN</b>  |                          |         |          |                              | <b>MONTENEGRO</b>                                  |                          |         |                  |                              |
| VEDANTA RESOURCES<br>FINANCE 8,95 % 11.03.25                      | 200.000                  | USD     | 153.747  | 0,42                         | MONTENEGRO (GOVT) 7,25 %<br>12/03/2031             |                          |         |                  |                              |
|   |                          |         |          |                              |  | 450.000                  | USD     | 458.367          | 1,25                         |
|   |                          |         |          |                              |  |                          |         | <b>458.367</b>   | <b>1,25</b>                  |
| <b>HONGKONG</b>   |                          |         |          |                              |  |                          |         |                  |                              |
| STUDIO CITY FINANCE 5 %<br>15.01.29                               | 300.000                  | USD     | 264.433  | 0,72                         |  |                          |         |                  |                              |
|   |                          |         |          |                              |  |                          |         |                  |                              |
|   |                          |         |          |                              |  |                          |         |                  |                              |
|   |                          |         |          |                              |  |                          |         |                  |                              |
| <b>UNGARN</b>   |                          |         |          |                              |  |                          |         |                  |                              |
| HUNGARY (GOVT) 5,5 %<br>26.03.36                                  | 220.000                  | USD     | 214.104  | 0,58                         |  |                          |         |                  |                              |
|   |                          |         |          |                              |  |                          |         |                  |                              |
|   |                          |         |          |                              |  |                          |         |                  |                              |
|   |                          |         |          |                              |  |                          |         |                  |                              |
|   |                          |         |          |                              |  |                          |         |                  |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

GEM Debt Total Return (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert       | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|------------------|------------------------------|---|--------------------------|---------|----------------|------------------------------|
| <b>OMAN</b>   |                          |         |                  |                              | ABU DHABI NATIONAL ENERGY 4 % 03.10.49  |                          |         |                |                              |
| LAMAR FUNDING 3,958 %<br>07/05/2025                   | 500.000                  | USD     | 488.172          | 1,33                         | FIRST ABU DHABI BANK<br>5 % 28.02.29  | 500.000                  | USD     | 497.884        | 1,35                         |
|   |                          |         | <b>488.172</b>   | <b>1,33</b>                  | MDGH GMTN 5,5 % 28.04.2033  | 350.000                  | USD     | 362.783        | 0,99                         |
| <b>PARAGUAY</b>                                       |                          |         |                  |                              | <b>1.480.849</b> <b>4,03</b>  |                          |         |                |                              |
| PARAGUAY (GOVT) 7,9 %<br>09/02/2031                   | 3.650.000.000            | PYG     | 512.463          | 1,39                         | <b>USA</b>  |                          |         |                |                              |
|   |                          |         | <b>512.463</b>   | <b>1,39</b>                  | SASOL FINANCING 8,75 %<br>03/05/2029  | 300.000                  | USD     | 305.575        | 0,83                         |
| <b>PERU</b>   |                          |         |                  |                              | <b>305.575</b> <b>0,83</b>  |                          |         |                |                              |
| BANCO INTERNACIONAL<br>7,625 % VRN 16.01.34           | 230.000                  | USD     | 239.875          | 0,65                         | <b>URUGUAY</b>  |                          |         |                |                              |
| PERU (GOVT) 6,9 %<br>12/08/2037                       | 3.000.000                | PEN     | 769.983          | 2,09                         | URUGUAY (GOVT) 5,75 %<br>28.10.34   | 600.000                  | USD     | 634.200        | 1,72                         |
| PETROLEOS DEL PERU<br>4,75 % 19.06.32                 | 400.000                  | USD     | 314.697          | 0,86                         |   |                          |         | <b>634.200</b> | <b>1,72</b>                  |
|   |                          |         | <b>1.324.555</b> | <b>3,60</b>                  | <b>USBKISTAN</b>  |                          |         |                |                              |
| <b>RUMÄNIEN</b>                                       |                          |         |                  |                              | UZBEKISTAN (GOVT)<br>16,25 % 12.10.26   |                          |         |                |                              |
| ROMANIAN (GOVT) 6,375 %<br>30.01.34                   | 200.000                  | USD     | 203.217          | 0,55                         | 4.200.000.000   | UZS                      | 330.741 | 0,90           |                              |
|   |                          |         | <b>203.217</b>   | <b>0,55</b>                  |   |                          |         | <b>330.741</b> | <b>0,90</b>                  |
| <b>SAUDI-ARABIEN</b>                                  |                          |         |                  |                              | <b>SUMME ANLEIHEN</b>   |                          |         |                |                              |
| GACI FIRST INVESTMENT<br>5,375 % 29.01.54             | 500.000                  | USD     | 445.753          | 1,21                         | <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN<br/>BÖRSE NOTIERTEN WERTPAPIERE<br/>WERTPAPIERE</b> |                          |         |                |                              |
| SAUDI (GOVT) 5,75 %<br>16.01.54                       | 300.000                  | USD     | 297.475          | 0,81                         | <b>23.173.386</b> <b>63,02</b>  |                          |         |                |                              |
|   |                          |         | <b>743.228</b>   | <b>2,02</b>                  | <b>AN EINEM ANDEREM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE, ÜBERTRAGBARE<br/>WERTPAPIERE</b>    |                          |         |                |                              |
| <b>SÜDAFRIKA</b>                                      |                          |         |                  |                              | <b>ANLEIHEN</b>   |                          |         |                |                              |
| SOUTH AFRICA (GOVT)<br>6,25 % 08.03.41                | 1.000.000                | USD     | 827.469          | 2,25                         | <b>BRASILIEN</b>  |                          |         |                |                              |
| SOUTH AFRICA (GOVT) 9 %<br>31.01.40                   | 15.000.140               | ZAR     | 585.278          | 1,59                         | BANCO DO BRASIL 6,25 %<br>VRN PERP  |                          |         |                |                              |
|   |                          |         | <b>1.412.747</b> | <b>3,84</b>                  | 300.000 USD 301.868 0,82  |                          |         |                |                              |
| <b>SRI LANKA</b>                                      |                          |         |                  |                              | ITAU UNIBANCO HOLDING<br>4,625 % PERP   |                          |         |                |                              |
| SRI LANKA (GOVT) 7,55 %<br>28.03.30                   | 600.000                  | USD     | 353.950          | 0,96                         | 400.000 USD 375.426 1,02  |                          |         |                |                              |
|   |                          |         | <b>353.950</b>   | <b>0,96</b>                  | MC BRAZIL DOWNSTREAM<br>TRADING 7,25 % 30.06.2031                                   |                          |         |                |                              |
| <b>THAILAND</b>                                       |                          |         |                  |                              | 250.000 USD 216.106 0,59  |                          |         |                |                              |
| THAILAND (GOVT) 2,875 %<br>17.06.46                   | 17.800.000               | THB     | 474.895          | 1,29                         | SAMARCO MINERACAO 9,5 %<br>30.06.31   |                          |         |                |                              |
|   |                          |         | <b>474.895</b>   | <b>1,29</b>                  | 750.000 USD 678.581 1,85  |                          |         |                |                              |
| <b>TRINIDAD &amp; TOBAGO</b>                          |                          |         |                  |                              | <b>1.571.981</b> <b>4,28</b>  |                          |         |                |                              |
| TRINIDAD & TOBAGO<br>(GOVT) 5,95 % 14.01.2031         | 220.000                  | USD     | 221.113          | 0,60                         | <b>CHILE</b>  |                          |         |                |                              |
|   |                          |         | <b>221.113</b>   | <b>0,60</b>                  | CHILE (GOVT) 2,45 %<br>31.01.31   |                          |         |                |                              |
| <b>TÜRKEI</b>   |                          |         |                  |                              | 750.000 USD 643.186 1,75  |                          |         |                |                              |
| AKBANK 9,3686 % VRN PERP                              | 400.000                  | USD     | 398.500          | 1,09                         | CORP NACIONAL DEL COBRE   |                          |         |                |                              |
| ISTANBUL METROPOLITAN<br>MUNICIPALI 10,5 % 06.12.2028 | 218.000                  | USD     | 233.401          | 0,63                         | DE CHILE 3,15 % 15.01.2051  |                          |         |                |                              |
|   |                          |         | <b>631.901</b>   | <b>1,72</b>                  | 250.000 USD 156.409 0,43  |                          |         |                |                              |
| <b>VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE</b>                   |                          |         |                  |                              | EMPRESA NACIONAL DEL<br>PETROLEO 3,75 % 05.08.2026                                  |                          |         |                |                              |
| ABU DHABI COMMERCIAL<br>BANK 5,5 % 12.01.29           | 250.000                  | USD     | 254.201          | 0,69                         | 650.000 USD 621.572 1,69  |                          |         |                |                              |
|   |                          |         |                  |                              | INVERSIONES CMPC 6,125 %<br>26.02.34  |                          |         |                |                              |
|   |                          |         |                  |                              | 503.000 USD 511.534 1,39  |                          |         |                |                              |
|   |                          |         |                  |                              | <b>1.932.701</b> <b>5,26</b>  |                          |         |                |                              |
|   |                          |         |                  |                              | <b>KOLUMBIEN</b>  |                          |         |                |                              |
|   |                          |         |                  |                              | BANCO GNB SUDAMERIS<br>7,5 % VRN 16.04.31   |                          |         |                |                              |
|   |                          |         |                  |                              | 400.000 USD 343.239 0,93  |                          |         |                |                              |
|   |                          |         |                  |                              | <b>343.239</b> <b>0,93</b>  |                          |         |                |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

GEM Debt Total Return (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung                   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung                                       | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------------------|--------------------------|---------|------------------|------------------------------|--|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|
| <b>COSTA RICA</b>              |                          |         |                  |                              | <b>SAMBIA</b>                                      |                          |         |                   |                              |
| COSTA RICA (GOVT)              |                          |         |                  |                              | ZAMBIA (GOVT) 8,5 %                                |                          |         |                   |                              |
| 6,125 % 19.02.31               | 220.000                  | USD     | 223.136          | 0,61                         | 14.04.24   | 350.000                  | USD     | 259.101           | 0,70                         |
| COSTA RICA (GOVT) 7,3 %        |                          |         |                  |                              |  |                          |         | <b>259.101</b>    | <b>0,70</b>                  |
| 13.11.54                       | 300.000                  | USD     | 319.305          | 0,87                         |  |                          |         | <b>10.478.600</b> | <b>28,50</b>                 |
|                                |                          |         | <b>542.441</b>   | <b>1,48</b>                  | <b>SUMME ANLEIHEN</b>                              |                          |         |                   |                              |
| <b>DOMINIKANISCHE REPUBLIK</b> |                          |         |                  |                              | <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN</b>                |                          |         | <b>10.478.600</b> | <b>28,50</b>                 |
| DOMINIC (GOVT) 5,5 %           |                          |         |                  |                              | <b>MARKT GEHANDELTEN ÜBERTRAGBAREN WERTPAPIERE</b> |                          |         |                   |                              |
| 22.02.29                       | 600.000                  | USD     | 583.608          | 1,58                         |  |                          |         |                   |                              |
| DOMINIC (GOVT) 5,875 %         |                          |         |                  |                              | <b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>           |                          |         |                   |                              |
| 30.01.60                       | 300.000                  | USD     | 255.680          | 0,70                         | <b>IRLAND</b>                                      |                          |         |                   |                              |
| DOMINIC (GOVT) 6 %             |                          |         |                  |                              | HSBC GLOBAL LIQUIDITY                              |                          |         |                   |                              |
| 22.02.33                       | 200.000                  | USD     | 194.777          | 0,53                         | FUND   | 2.772                    | USD     | 2.772             | 0,01                         |
|                                |                          |         | <b>1.034.065</b> | <b>2,81</b>                  | HSBC US DOLLAR ESG                                 |                          |         |                   |                              |
| <b>GROSSBRITANNIEN</b>         |                          |         |                  |                              | LIQUIDITY FUND Y INC                               | 19                       | USD     | 19                | 0,00                         |
| LIQUID TELECOMMUNICATIONS      |                          |         |                  |                              |  |                          |         | <b>2.791</b>      | <b>0,01</b>                  |
| FINANCIAL 5,5 % 04.09.2026     | 500.000                  | USD     | 295.596          | 0,80                         | <b>SUMME ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>     |                          |         | <b>2.791</b>      | <b>0,01</b>                  |
| STANDARD CHARTERED             |                          |         |                  |                              | <b>SUMME WERTPAPIERANLAGEN</b>                     |                          |         | <b>33.654.777</b> | <b>91,53</b>                 |
| 7,875 % VRN PERP               | 500.000                  | USD     | 499.305          | 1,36                         | <b>SONSTIGES NETTOVERMÖGEN</b>                     |                          |         | <b>3.116.268</b>  | <b>8,47</b>                  |
|                                |                          |         | <b>794.901</b>   | <b>2,16</b>                  | <b>GESAMTNETTOVERMÖGEN</b>                         |                          |         | <b>36.771.045</b> | <b>100,00</b>                |
| <b>LUXEMBURG</b>               |                          |         |                  |                              |  |                          |         |                   |                              |
| AEGEA FINANCE 6,75 %           |                          |         |                  |                              |  |                          |         |                   |                              |
| 20.05.29                       | 400.000                  | USD     | 391.377          | 1,06                         |  |                          |         |                   |                              |
| MEXICO REMITTANCES             |                          |         |                  |                              |  |                          |         |                   |                              |
| FUNDING 4,875 % 15.01.2028     | 883.000                  | USD     | 633.631          | 1,72                         |  |                          |         |                   |                              |
| MILLICOM INTERNATIONAL         |                          |         |                  |                              |  |                          |         |                   |                              |
| CELLULAR 7,375 % 02.04.2032    | 450.000                  | USD     | 450.500          | 1,23                         |  |                          |         |                   |                              |
| RAIZEN FUELS FINANCE           |                          |         |                  |                              |  |                          |         |                   |                              |
| 6,45 % 05.03.34                | 300.000                  | USD     | 308.037          | 0,84                         |  |                          |         |                   |                              |
|                                |                          |         | <b>1.783.545</b> | <b>4,85</b>                  |  |                          |         |                   |                              |
| <b>MEXIKO</b>                  |                          |         |                  |                              |  |                          |         |                   |                              |
| BRASKEM IDESAPI 6,99 %         |                          |         |                  |                              |  |                          |         |                   |                              |
| 20.02.32                       | 900.000                  | USD     | 700.225          | 1,90                         |  |                          |         |                   |                              |
| MEXICO (GOVT) 6 %              |                          |         |                  |                              |  |                          |         |                   |                              |
| 07/05/2036                     | 350.000                  | USD     | 351.971          | 0,96                         |  |                          |         |                   |                              |
|                                |                          |         | <b>1.052.196</b> | <b>2,86</b>                  |  |                          |         |                   |                              |
| <b>NIGERIA</b>                 |                          |         |                  |                              |  |                          |         |                   |                              |
| NIGERIA (GOVT) 7,875 %         |                          |         |                  |                              |  |                          |         |                   |                              |
| 16.02.32                       | 400.000                  | USD     | 363.228          | 0,99                         |  |                          |         |                   |                              |
|                                |                          |         | <b>363.228</b>   | <b>0,99</b>                  |  |                          |         |                   |                              |
| <b>POLEN</b>                   |                          |         |                  |                              |  |                          |         |                   |                              |
| REPUBLIC OF POLAND GOVERNMENT  |                          |         |                  |                              |  |                          |         |                   |                              |
| INT 5,5 % 18.03.54             | 300.000                  | USD     | 298.764          | 0,81                         |  |                          |         |                   |                              |
|                                |                          |         | <b>298.764</b>   | <b>0,81</b>                  |  |                          |         |                   |                              |
| <b>TÜRKEI</b>                  |                          |         |                  |                              |  |                          |         |                   |                              |
| TURKIYE IHRACAT KREDI          |                          |         |                  |                              |  |                          |         |                   |                              |
| BANKASI AS 7,5 % 06.02.2028    | 500.000                  | USD     | 502.438          | 1,37                         |  |                          |         |                   |                              |
|                                |                          |         | <b>502.438</b>   | <b>1,37</b>                  |  |                          |         |                   |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Bond

Aufstellung der Wertpapiieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert       | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung                | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|----------------|------------------------------|-----------------------------|--------------------------|---------|------------------|------------------------------|
| <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>  |                          |         |                |                              | ELIS 3,75 % 21.03.30        | 100.000                  | EUR     | 107.725          | 0,29                         |
| <b>AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |                          |         |                |                              | FRANCE (GOVT) 0 %           |                          |         |                  |                              |
| <b>ANLEIHEN</b>   |                          |         |                |                              | 25.11.30                    | 40.000                   | EUR     | 36.346           | 0,10                         |
| <b>AUSTRALIEN</b>   |                          |         |                |                              | FRANCE (GOVT) 1,5 %         |                          |         |                  |                              |
| AUSTRALIA (GOVT) 4,25 %   |                          |         |                |                              | 25.05.50                    | 180.000                  | EUR     | 136.085          | 0,36                         |
| 21.04.26  | 91.000                   | AUD     | 60.035         | 0,16                         | FRANCE (GOVT) 1,75 %        |                          |         |                  |                              |
| AUSTRALIA (GOVT) 4,50 %   |                          |         |                |                              | 25.06.39                    | 242.000                  | EUR     | 221.259          | 0,58                         |
| 21.04.33  | 60.000                   | AUD     | 40.755         | 0,11                         | FRANCE (GOVT) 2,5 %         |                          |         |                  |                              |
| NEW SOUTH WALES   |                          |         |                |                              | 25.05.30                    | 150.000                  | EUR     | 160.869          | 0,43                         |
| TREASURY 4,75 % 20.02.2035  | 240.000                  | AUD     | 157.029        | 0,42                         | RCI BANQUE 4,875 %          |                          |         |                  |                              |
| QUEENSLAND TREASURY   |                          |         |                |                              | 02/10/2029                  | 106.000                  | EUR     | 119.800          | 0,32                         |
| 4,50 % 09.03.33   | 136.000                  | AUD     | 89.283         | 0,24                         | TELEPERFORMANCE 5,75 %      |                          |         |                  |                              |
| SOUTH AUSTRALIAN GOVERNMENT                                       |                          |         |                |                              | 22.11.31                    | 100.000                  | EUR     | 113.426          | 0,30                         |
| FINANCE 4,75 % 24.05.38   | 220.000                  | AUD     | 139.979        | 0,37                         | VEOLIA ENVIRONNEMENT        |                          |         |                  |                              |
| TRANSURBAN FINANCE  |                          |         |                |                              | 2,5 % VRN PERP              | 100.000                  | EUR     | 97.296           | 0,26                         |
| 3,713 % 12.03.32  | 100.000                  | EUR     | 109.171        | 0,29                         |                             |                          |         | <b>1.868.726</b> | <b>4,98</b>                  |
|   |                          |         | <b>596.252</b> | <b>1,59</b>                  | <b>DEUTSCHLAND</b>          |                          |         |                  |                              |
| <b>BELGIEN</b>  |                          |         |                |                              | BUNDESOBLIGATION 2,10 %     |                          |         |                  |                              |
| SOLVAY 4,25 % 03.10.31  | 100.000                  | EUR     | 107.772        | 0,29                         | 12/04/2029                  | 403.000                  | EUR     | 430.801          | 1,16                         |
|   |                          |         | <b>107.772</b> | <b>0,29</b>                  | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND  |                          |         |                  |                              |
| <b>KANADA</b>   |                          |         |                |                              | BUNDES 2,10 % 15.11.29      | 131.000                  | EUR     | 140.099          | 0,37                         |
| ALIMENTATION COUCHE   |                          |         |                |                              | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND  |                          |         |                  |                              |
| 3,647 % 12.05.31  | 100.000                  | EUR     | 108.447        | 0,29                         | BUNDES 2,20 % 15.02.34      | 90.000                   | EUR     | 96.414           | 0,26                         |
| PROVINCE OF QUEBEC  |                          |         |                |                              | DEUTSCHE BAHN FINANCE       |                          |         |                  |                              |
| CANADA 3,1 % 01.12.51   | 100.000                  | CAD     | 59.775         | 0,16                         | 3,375 % 29.01.38            | 52.000                   | EUR     | 56.019           | 0,15                         |
|   |                          |         | <b>168.222</b> | <b>0,45</b>                  | DEUTSCHE BAHN FINANCE       |                          |         |                  |                              |
| <b>CHILE</b>  |                          |         |                |                              | 6,016 % 17.11.33            | 40.000                   | AUD     | 27.645           | 0,07                         |
| CORP NACIONAL DEL COBRE   |                          |         |                |                              | DEUTSCHE BANK 3,961 %       |                          |         |                  |                              |
| 5,125 % 02.02.33  | 200.000                  | USD     | 190.274        | 0,51                         | VRN 26.11.25                | 150.000                  | USD     | 148.011          | 0,39                         |
|   |                          |         | <b>190.274</b> | <b>0,51</b>                  | EUROGRID 3,915 %            |                          |         |                  |                              |
| <b>CHINA</b>  |                          |         |                |                              | 01/02/2034                  | 100.000                  | EUR     | 110.289          | 0,29                         |
| CHINA(GOVT) 1,99 %  |                          |         |                |                              | GERMANY (GOVT) 0 %          |                          |         |                  |                              |
| 09/04/2025  | 5.000.000                | CNY     | 689.771        | 1,84                         | 09/10/2026                  | 250.000                  | EUR     | 253.058          | 0,67                         |
|   |                          |         | <b>689.771</b> | <b>1,84</b>                  | GERMANY (GOVT) 1,25 %       |                          |         |                  |                              |
| <b>FRANKREICH</b>   |                          |         |                |                              | 15.08.48                    | 145.000                  | EUR     | 122.503          | 0,33                         |
| ACCOR 3,875 % 11.03.31  | 100.000                  | EUR     | 109.016        | 0,29                         | GERMANY (GOVT) 3,25 %       |                          |         |                  |                              |
| BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT                                       |                          |         |                |                              | 04/07/2042                  | 229.000                  | EUR     | 275.120          | 0,73                         |
| MUTUEL 4,75 % 10.11.31  | 100.000                  | EUR     | 115.037        | 0,31                         |                             |                          |         | <b>1.659.959</b> | <b>4,42</b>                  |
| BNP PARIBAS 2,518 %   |                          |         |                |                              | <b>GROSSBRITANNIEN</b>      |                          |         |                  |                              |
| 05/06/2025  | 200.000                  | AUD     | 126.604        | 0,34                         | BARCLAYS 4,506 % VRN        |                          |         |                  |                              |
| BNP PARIBAS 4,75 % VRN  |                          |         |                |                              | 31.01.33                    | 133.000                  | EUR     | 147.430          | 0,39                         |
| 13.11.32  | 100.000                  | EUR     | 114.790        | 0,31                         | BARCLAYS 8,407 % VRN        |                          |         |                  |                              |
| CREDIT AGRICOLE 4,125 %   |                          |         |                |                              | 14.11.32                    | 100.000                  | GBP     | 134.559          | 0,36                         |
| 26.02.36  | 100.000                  | EUR     | 111.215        | 0,30                         | HEATHROW FUNDING 6 %        |                          |         |                  |                              |
| CREDIT AGRICOLE 6,5 %   |                          |         |                |                              | 05/03/2032                  | 150.000                  | GBP     | 192.043          | 0,51                         |
| VRN PERP  | 100.000                  | EUR     | 109.857        | 0,29                         | LLOYDS BANKING GROUP        |                          |         |                  |                              |
| ELECTRICITE DE FRANCE   |                          |         |                |                              | 4,75 % 23.05.28             | 100.000                  | AUD     | 63.830           | 0,17                         |
| 3,375 % VRN PERP  | 200.000                  | EUR     | 189.401        | 0,50                         | NATIONWIDE BUILDING SOCIETY |                          |         |                  |                              |
|   |                          |         |                |                              | 6,557 % VRN 18.10.27        | 200.000                  | USD     | 205.339          | 0,55                         |
|   |                          |         |                |                              | NGG FINANCE 5,625 % VRN     |                          |         |                  |                              |
|   |                          |         |                |                              | 18.06.73                    | 200.000                  | GBP     | 250.407          | 0,66                         |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung               | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung               | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|----------------------------|--------------------------|---------|------------------|------------------------------|----------------------------|--------------------------|---------|------------------|------------------------------|
| ROTHESAY LIFE 8 %          |                          |         |                  |                              | JAPAN (GOVT) 0,1 %         |                          |         |                  |                              |
| 30.10.25                   | 100.000                  | GBP     | 130.072          | 0,35                         | 20.09.30                   | 25.000.000               | JPY     | 161.870          | 0,44                         |
| SSE PLC 4 % 05.09.2031     | 121.000                  | EUR     | 135.311          | 0,36                         | JAPAN (GOVT) 0,1 %         |                          |         |                  |                              |
| UK (GOVT) 0,375 %          |                          |         |                  |                              | 20.06.31                   | 16.000.000               | JPY     | 102.893          | 0,27                         |
| 22.10.26                   | 104.000                  | GBP     | 119.779          | 0,32                         | JAPAN (GOVT) 0,4 %         |                          |         |                  |                              |
| UK (GOVT) 0,375 %          |                          |         |                  |                              | 20.03.50                   | 29.000.000               | JPY     | 141.083          | 0,38                         |
| 22.10.30                   | 175.000                  | GBP     | 178.149          | 0,48                         | JAPAN (GOVT) 0,5 %         |                          |         |                  |                              |
| UK (GOVT) 1,50 %           |                          |         |                  |                              | 20.12.32                   | 10.000.000               | JPY     | 65.500           | 0,17                         |
| 22.07.47                   | 35.000                   | GBP     | 25.704           | 0,07                         | JAPAN (GOVT) 0,5 %         |                          |         |                  |                              |
| UK (GOVT) 1,75 %           |                          |         |                  |                              | 20.06.38                   | 29.000.000               | JPY     | 177.331          | 0,48                         |
| 22.01.49                   | 220.000                  | GBP     | 168.068          | 0,45                         | JAPAN (GOVT) 0,7 %         |                          |         |                  |                              |
| UK (GOVT) 3,25 %           |                          |         |                  |                              | 20.12.48                   | 22.500.000               | JPY     | 121.319          | 0,32                         |
| 31.01.33                   | 665.000                  | GBP     | 801.515          | 2,13                         | JAPAN (GOVT) 0,7 %         |                          |         |                  |                              |
| UK (GOVT) 3,5 % 22.07.2068 | 105.000                  | GBP     | 112.343          | 0,30                         | 20.12.50                   | 5.000.000                | JPY     | 26.129           | 0,07                         |
| UK (GOVT) 4,625 %          |                          |         |                  |                              | JAPAN (GOVT) 1,1 %         |                          |         |                  |                              |
| 31.01.34                   | 75.000                   | GBP     | 100.127          | 0,27                         | 20.03.43                   | 15.000.000               | JPY     | 94.311           | 0,25                         |
| VIRGIN MONEY 4,00 % VRN    |                          |         |                  |                              | JAPAN (GOVT) 1,4 %         |                          |         |                  |                              |
| 18.03.28                   | 100.000                  | EUR     | 108.441          | 0,29                         | 20.09.34                   | 15.000.000               | JPY     | 105.460          | 0,28                         |
|                            |                          |         | <b>2.873.117</b> | <b>7,66</b>                  | JAPAN (GOVT) 1,6 %         |                          |         |                  |                              |
| <b>UNGARN</b>              |                          |         |                  |                              | 20.12.53                   | 23.000.000               | JPY     | 147.127          | 0,40                         |
| HUNGARY (GOVT) 4 %         |                          |         |                  |                              |                            |                          |         | <b>1.416.321</b> | <b>3,78</b>                  |
| 25.07.29                   | 47.000                   | EUR     | 50.694           | 0,14                         | <b>LUXEMBURG</b>           |                          |         |                  |                              |
|                            |                          |         | <b>50.694</b>    | <b>0,14</b>                  | EIB 2,15 % 18.01.27        | 76.100.000               | JPY     | 531.266          | 1,42                         |
| <b>IRLAND</b>              |                          |         |                  |                              | LOGICOR FINANCING          |                          |         |                  |                              |
| AVOLON HOLDINGS FUNDING    |                          |         |                  |                              | 4,625 % 25.07.28           | 100.000                  | EUR     | 109.359          | 0,29                         |
| 5,75 % 01.03.29            | 134.000                  | USD     | 133.666          | 0,36                         |                            |                          |         | <b>640.625</b>   | <b>1,71</b>                  |
| CA AUTO BANK 4,75 %        |                          |         |                  |                              | <b>MEXIKO</b>              |                          |         |                  |                              |
| 25.01.27                   | 138.000                  | EUR     | 152.709          | 0,41                         | MEXICO (GOVT) 4,4899 %     |                          |         |                  |                              |
| CA AUTO BANK               |                          |         |                  |                              | 25.05.32                   | 130.000                  | EUR     | 142.981          | 0,38                         |
| 6 % 06.12.26               | 120.000                  | GBP     | 153.942          | 0,40                         | MEXICO (GOVT) 7,75 %       |                          |         |                  |                              |
|                            |                          |         | <b>440.317</b>   | <b>1,17</b>                  | 13.11.42                   | 40.000                   | MXN     | 205.450          | 0,55                         |
| <b>ITALIEN</b>             |                          |         |                  |                              |                            |                          |         | <b>348.431</b>   | <b>0,93</b>                  |
| ENEL 4,75 % VRN PERP       | 100.000                  | EUR     | 107.385          | 0,29                         | <b>NIEDERLANDE</b>         |                          |         |                  |                              |
| ITALGAS SPA 3,125 %        |                          |         |                  |                              | CTP 4,75 % 05.02.30        | 100.000                  | EUR     | 109.633          | 0,29                         |
| 08/02/2029                 | 123.000                  | EUR     | 130.741          | 0,35                         | NETHERLANDS (GOVT) 0 %     |                          |         |                  |                              |
| ITALY (GOVT) 0,35 %        |                          |         |                  |                              | 15.07.31                   | 100.000                  | EUR     | 90.330           | 0,24                         |
| 01/02/2025                 | 550.000                  | EUR     | 578.634          | 1,55                         | NETHERLANDS (GOVT)         |                          |         |                  |                              |
| ITALY (GOVT) 1,35 %        |                          |         |                  |                              | 0,75 % 15.07.27            | 255.000                  | EUR     | 259.898          | 0,70                         |
| 01/04/2030                 | 415.000                  | EUR     | 401.996          | 1,07                         | RELX FINANCE 3,375 %       |                          |         |                  |                              |
| ITALY (GOVT) 3,85 %        |                          |         |                  |                              | 20.03.33                   | 100.000                  | EUR     | 108.354          | 0,29                         |
| 01/09/2049                 | 160.000                  | EUR     | 166.353          | 0,44                         |                            |                          |         | <b>568.215</b>   | <b>1,52</b>                  |
| ITALY (GOVT) 4,2 %         |                          |         |                  |                              | <b>NEUSEELAND</b>          |                          |         |                  |                              |
| 01/03/2034                 | 100.000                  | EUR     | 113.104          | 0,30                         | NEW ZEALAND (GOVT) 3,5 %   |                          |         |                  |                              |
|                            |                          |         | <b>1.498.213</b> | <b>4,00</b>                  | 14.04.33                   | 1.750.000                | NZD     | 966.792          | 2,58                         |
| <b>JAPAN</b>               |                          |         |                  |                              |                            |                          |         | <b>966.792</b>   | <b>2,58</b>                  |
| JAPAN (GOVT) 0,1 %         |                          |         |                  |                              | <b>PORTUGAL</b>            |                          |         |                  |                              |
| 20.03.29                   | 15.000.000               | JPY     | 97.853           | 0,26                         | PORTUGAL (GOVT) 1,95 %     |                          |         |                  |                              |
| JAPAN (GOVT) 0,1 %         |                          |         |                  |                              | 15.06.29                   | 100.000                  | EUR     | 104.796          | 0,28                         |
| 20.12.29                   | 10.000.000               | JPY     | 65.034           | 0,17                         | PORTUGAL OBRIGACOES DO     |                          |         |                  |                              |
| JAPAN (GOVT) 0,1 %         |                          |         |                  |                              | TESOURO 2,875 % 20.10.2034 | 100.000                  | EUR     | 106.920          | 0,28                         |
| 20.03.30                   | 17.000.000               | JPY     | 110.411          | 0,29                         |                            |                          |         | <b>211.716</b>   | <b>0,56</b>                  |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung                        | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|-------------------------------------|--------------------------|---------|------------------|------------------------------|--|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|
| <b>SÜDKOREA</b>                     |                          |         |                  |                              | GLOBAL PAYMENTS 4,875 %  |                          |         |                   |                              |
| KOREA (GOVT) 3,25 %                 |                          |         |                  |                              | 17.03.31   | 131.000                  | EUR     | 149.437           | 0,40                         |
| 10/03/2028                          | 200.000.000              | KRW     | 148.146          | 0,40                         | GLOBAL PAYMENTS 5,3 %  |                          |         |                   |                              |
| KOREA (GOVT) 3,25 %                 |                          |         |                  |                              | 15.08.29   | 170.000                  | USD     | 169.557           | 0,45                         |
| 10/06/2033                          | 165.000.000              | KRW     | 121.169          | 0,32                         | HCA 6 % 01.04.54   | 60.000                   | USD     | 61.100            | 0,16                         |
| KOREA (GOVT) 3,25 %                 |                          |         |                  |                              | MCDONALDS 4,125 %  |                          |         |                   |                              |
| 10/03/2053                          | 80.000.000               | KRW     | 59.051           | 0,16                         | 28.11.35   | 129.000                  | EUR     | 145.688           | 0,39                         |
|                                     |                          |         | <b>328.366</b>   | <b>0,88</b>                  | MORGAN STANLEY 3,955 %   |                          |         |                   |                              |
| <b>SPANIEN</b>                      |                          |         |                  |                              | VRN 21.03.35   | 132.000                  | EUR     | 144.831           | 0,39                         |
| BANCO SANTANDER 5,538 %             |                          |         |                  |                              | MORGAN STANLEY 5,449 %   |                          |         |                   |                              |
| VRN 14.03.30                        | 200.000                  | USD     | 200.092          | 0,54                         | VRN 20.07.29   | 19.000                   | USD     | 19.188            | 0,05                         |
| CAIXABANK 4,25 %                    |                          |         |                  |                              | REALTY INCOME 5,75 %   |                          |         |                   |                              |
| 06/09/2030                          | 100.000                  | EUR     | 112.526          | 0,30                         | 05/12/2031   | 190.000                  | GBP     | 248.748           | 0,66                         |
| CAIXABANK 5,673 % VRN               |                          |         |                  |                              | SEMPRA ENERGY 5,5 %  |                          |         |                   |                              |
| 15.03.30                            | 200.000                  | USD     | 200.047          | 0,53                         | 01/08/2033   | 150.000                  | USD     | 150.671           | 0,40                         |
| CELLNEX FINANCE 1 %                 |                          |         |                  |                              | US (GOVT) 3,875 %  |                          |         |                   |                              |
| 15.09.27                            | 100.000                  | EUR     | 99.021           | 0,26                         | 15.05.43   | 158.000                  | USD     | 146.273           | 0,39                         |
| IBERDROLA FINANZAS                  |                          |         |                  |                              | US (GOVT) 4 % 15.01.2027   |                          |         |                   |                              |
| 4,871 % VRN PERP                    | 100.000                  | EUR     | 109.155          | 0,29                         | US (GOVT) 4 % 31.01.29   | 2.078.000                | USD     | 2.058.761         | 5,49                         |
| SPAIN (GOVT) 0,1 %                  |                          |         |                  |                              | US (GOVT) 4 % 31.01.31   |                          |         |                   |                              |
| 30.04.31                            | 130.000                  | EUR     | 115.611          | 0,31                         | US (GOVT) 4,125 %  |                          |         |                   |                              |
| SPAIN (GOVT) 0,50 %                 |                          |         |                  |                              | 15.02.27   | 200.000                  | USD     | 198.469           | 0,53                         |
| 30.04.30                            | 140.000                  | EUR     | 131.689          | 0,35                         | US (GOVT) 4,25 %   |                          |         |                   |                              |
| SPAIN (GOVT) 2,9 %                  |                          |         |                  |                              | 15.02.54   | 120.000                  | USD     | 118.397           | 0,32                         |
| 31.10.46                            | 157.000                  | EUR     | 151.246          | 0,40                         | US (GOVT) 4,625 %  |                          |         |                   |                              |
| SPAIN (GOVT) 3,15 %                 |                          |         |                  |                              | 28.02.26   | 400.000                  | USD     | 399.859           | 1,07                         |
| 30.04.33                            | 100.000                  | EUR     | 108.763          | 0,29                         | XCEL ENERGY 5,45 %   |                          |         |                   |                              |
| SPAIN (GOVT) 3,25 %                 |                          |         |                  |                              | 15.08.33   | 93.000                   | USD     | 92.748            | 0,25                         |
| 30.04.34                            | 50.000                   | EUR     | 54.454           | 0,15                         |  |                          |         | <b>7.928.918</b>  | <b>21,15</b>                 |
|                                     |                          |         | <b>1.282.604</b> | <b>3,42</b>                  | <b>SUMME ANLEIHEN</b>  |                          |         |                   |                              |
|                                     |                          |         |                  |                              |  |                          |         | <b>24.034.458</b> | <b>64,11</b>                 |
| <b>VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE</b> |                          |         |                  |                              | <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>                          |                          |         |                   |                              |
| FIRST ABU DHABI BANK                |                          |         |                  |                              | <b>USA</b>   |                          |         |                   |                              |
| 5 % 28.02.29                        | 200.000                  | USD     | 199.153          | 0,53                         | FNMA 2,00 % TBA 15.04.2036                                       | 360.000                  | USD     | 319.416           | 0,85                         |
|                                     |                          |         | <b>199.153</b>   | <b>0,53</b>                  | FNMA 2,00 % TBA 15.04.51   | 590.000                  | USD     | 467.788           | 1,24                         |
| <b>USA</b>                          |                          |         |                  |                              | FNMA 2,50 % TBA 15.04.51   | 520.000                  | USD     | 430.937           | 1,15                         |
| AIR LEASE 3,7 % 15.04.2030          | 118.000                  | EUR     | 127.034          | 0,34                         | GNMA 2,50 % TBA 15.04.2051                                       | 200.000                  | USD     | 170.867           | 0,46                         |
| BANK OF AMERICA 5,468 %             |                          |         |                  |                              |  |                          |         | <b>1.389.008</b>  | <b>3,70</b>                  |
| VRN 23.01.35                        | 100.000                  | USD     | 100.880          | 0,27                         | <b>SUMME FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>                    |                          |         |                   |                              |
| BRISTOLMYERS SQUIBB                 |                          |         |                  |                              |  |                          |         | <b>1.389.008</b>  | <b>3,70</b>                  |
| 6,25 % 15.11.53                     | 21.000                   | USD     | 23.739           | 0,06                         | <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN</b>                              |                          |         |                   |                              |
| CARRIER GLOBAL 4,5 %                |                          |         |                  |                              | <b>BÖRSE NOTIERTEN WERTPAPIERE</b>                               |                          |         |                   |                              |
| 29.11.32                            | 100.000                  | EUR     | 114.724          | 0,31                         |  |                          |         | <b>25.423.466</b> | <b>67,81</b>                 |
| CNH INDUSTRIAL CAPITAL              |                          |         |                  |                              | <b>WERTPAPIERE</b>   |                          |         |                   |                              |
| 5,1 % 20.04.29                      | 111.000                  | USD     | 110.785          | 0,30                         | <b>AN EINEM ANDEREM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE, ÜBERTRAGBARE</b> |                          |         |                   |                              |
| DOW CHEMICAL 5,15 %                 |                          |         |                  |                              | <b>WERTPAPIERE</b>   |                          |         |                   |                              |
| 15.02.34                            | 95.000                   | USD     | 94.709           | 0,25                         | <b>ANLEIHEN</b>  |                          |         |                   |                              |
| ELI LILLY 5 % 09.02.2054            | 69.000                   | USD     | 68.845           | 0,18                         | <b>BELGIEN</b>   |                          |         |                   |                              |
| ENERGY TRANSFER 5,95 %              |                          |         |                  |                              | BELGIUM (GOVT) 1 %   |                          |         |                   |                              |
| 15.05.54                            | 14.000                   | USD     | 13.991           | 0,04                         | 22.06.31   | 200.000                  | EUR     | 192.428           | 0,51                         |
| FISERV 5,625 % 21.08.33             | 66.000                   | USD     | 67.554           | 0,18                         |  |                          |         | <b>192.428</b>    | <b>0,51</b>                  |
| FORD MOTOR CREDIT 7,35 %            |                          |         |                  |                              |  |                          |         |                   |                              |
| 06/03/2030                          | 200.000                  | USD     | 213.502          | 0,57                         |  |                          |         |                   |                              |
| GENERAL MOTORS FINANCIAL            |                          |         |                  |                              |  |                          |         |                   |                              |
| 6,1 % 07.01.34                      | 110.000                  | USD     | 113.126          | 0,30                         |  |                          |         |                   |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapiieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung                                     | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung                                       | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--------------------------|---------|------------------|------------------------------|--|--------------------------|---------|------------------|------------------------------|
| <b>KANADA</b>                                    |                          |         |                  |                              | LOGICOR FINANCING 2,25 %<br>13.05.25               |                          |         |                  |                              |
| CANADA (GOVT) 1,5 %<br>01/12/2031                | 345.000                  | CAD     | 221.646          | 0,59                         | MEXICO REMITTANCES<br>FUNDING 4,875 % 15.01.2028   | 200.000                  | USD     | 143.517          | 0,38                         |
| CANADA (GOVT) 1,75 %<br>01/12/2053               | 71.000                   | CAD     | 36.899           | 0,10                         |  |                          |         | <b>428.845</b>   | <b>1,14</b>                  |
|  |                          |         | <b>258.545</b>   | <b>0,69</b>                  | <b>NIEDERLANDE</b>                                 |                          |         |                  |                              |
| <b>CHINA</b>                                     |                          |         |                  |                              | FERROVIAL 4,375 %<br>13.09.30                      |                          |         |                  |                              |
| CHINA(GOVT) 3,27 %<br>19.11.30                   | 9.000.000                | CNY     | 1.315.402        | 3,51                         | IBERDROLA INTERNATIONAL<br>1,874 % VRN PERP        | 100.000                  | EUR     | 102.887          | 0,27                         |
| CHINA(GOVT) 3,39 %<br>16.03.50                   | 2.400.000                | CNY     | 376.774          | 1,00                         |  |                          |         | <b>261.610</b>   | <b>0,70</b>                  |
|  |                          |         | <b>1.692.176</b> | <b>4,51</b>                  | <b>POLEN</b>                                       |                          |         |                  |                              |
| <b>KOLUMBIEN</b>                                 |                          |         |                  |                              | POLAND (GOVT) 5,5 %<br>18.03.54                    |                          |         |                  |                              |
| COLOMBIA (GOVT) 3,125 %<br>15.04.31              | 200.000                  | USD     | 160.250          | 0,43                         |  | 115.000                  | USD     | 114.526          | 0,31                         |
|  |                          |         | <b>160.250</b>   | <b>0,43</b>                  |  |                          |         | <b>114.526</b>   | <b>0,31</b>                  |
| <b>FRANKREICH</b>                                |                          |         |                  |                              | <b>SCHWEDEN</b>                                    |                          |         |                  |                              |
| FRANCE (GOVT) 0 %<br>25.11.29                    | 20.000                   | EUR     | 18.671           | 0,05                         | SWEDEN (GOVT) 1 %<br>12/11/2026                    | 450.000                  | SEK     | 40.337           | 0,11                         |
|  |                          |         | <b>18.671</b>    | <b>0,05</b>                  |  |                          |         | <b>40.337</b>    | <b>0,11</b>                  |
| <b>DEUTSCHLAND</b>                               |                          |         |                  |                              | <b>USA</b>   |                          |         |                  |                              |
| DEUTSCHE BANK 4 % VRN<br>24.06.32                | 100.000                  | EUR     | 104.757          | 0,28                         | BAXTER INTERNATIONAL<br>2,272 % 01.12.28           | 89.000                   | USD     | 78.479           | 0,21                         |
| EON 3,5 % 25.03.32                               | 145.000                  | EUR     | 157.139          | 0,42                         | BRISTOLMYERS SQUIBB<br>5,55 % 22.02.54             | 63.000                   | USD     | 65.082           | 0,17                         |
| GERMANY (GOVT) 0,25 %<br>15.02.27                | 855.000                  | EUR     | 865.950          | 2,31                         | CHENIERE ENERGY 5,65 %<br>15.04.34                 | 51.000                   | USD     | 51.388           | 0,14                         |
|  |                          |         | <b>1.127.846</b> | <b>3,01</b>                  | DELTA AIR LINES 4,75 %<br>20.10.28                 | 142.941                  | USD     | 139.868          | 0,37                         |
| <b>GROSSBRITANNIEN</b>                           |                          |         |                  |                              | HCA 5,45 % 01.04.31                                |                          |         |                  |                              |
| ANGLO AMERICAN CAPITAL<br>4,125 % 15.03.32       | 100.000                  | EUR     | 108.448          | 0,29                         | JACKSON FINANCIAL 4 %<br>23.11.51                  | 97.000                   | USD     | 68.630           | 0,18                         |
| MACQUARIE AIRFINANCE<br>HOLDINGS 6,50 % 26.03.31 | 71.000                   | USD     | 72.361           | 0,19                         | MOHAWK INDUSTRIES 5,85 %<br>18.09.28               | 40.000                   | USD     | 41.238           | 0,11                         |
| VODAFONE GROUP 4,20 %<br>13.12.27                | 200.000                  | AUD     | 127.413          | 0,34                         | NEXTERA ENERGY CAPITAL<br>HOLDINGS 5,25 % 15.03.34 | 93.000                   | USD     | 92.875           | 0,25                         |
|  |                          |         | <b>308.222</b>   | <b>0,82</b>                  | US (GOVT) 1,375 % 15.11.40                         | 930.000                  | USD     | 600.141          | 1,60                         |
| <b>INDIEN</b>                                    |                          |         |                  |                              | US (GOVT) 1,375 % 15.08.50                         |                          |         |                  |                              |
| HDFC BANK 5,18 %<br>15.02.29                     | 250.000                  | USD     | 248.791          | 0,66                         | US (GOVT) 4,00 % 15.02.34                          | 1.968.000                | USD     | 1.938.634        | 5,17                         |
|  |                          |         | <b>248.791</b>   | <b>0,66</b>                  | US (GOVT) 4,25 %<br>28.02.29                       | 874.000                  | USD     | 876.014          | 2,34                         |
| <b>IRLAND</b>                                    |                          |         |                  |                              | VERALTO 4,15 % 19.09.2031                          |                          |         |                  |                              |
| AVOLON HOLDINGS FUNDING<br>4,25 % 15.04.26       | 22.000                   | USD     | 21.263           | 0,06                         | WARNERMEDIA HOLDINGS<br>5,05 % 15.03.42            | 58.000                   | USD     | 49.881           | 0,13                         |
|  |                          |         | <b>21.263</b>    | <b>0,06</b>                  | WEA FINANCE 2,875 %<br>15.01.27                    | 20.000                   | USD     | 18.378           | 0,05                         |
| <b>JAPAN</b>                                     |                          |         |                  |                              | <b>SUMME ANLEIHEN</b>                              |                          |         |                  |                              |
| JAPAN (GOVT) 2,00 %<br>20.03.27                  | 27.000.000               | JPY     | 187.895          | 0,50                         |  |                          |         | <b>4.786.495</b> | <b>12,76</b>                 |
|  |                          |         | <b>187.895</b>   | <b>0,50</b>                  |  |                          |         | <b>9.847.900</b> | <b>26,26</b>                 |
| <b>LUXEMBURG</b>                                 |                          |         |                  |                              |  |                          |         |                  |                              |
| BLACKSTONE PROPERTY<br>PARTNERS 2,625 % 20.10.28 | 100.000                  | GBP     | 109.923          | 0,29                         |  |                          |         |                  |                              |
| GRAND CITY PROPERTIES<br>1,50 % VRN PERP         | 100.000                  | EUR     | 69.815           | 0,19                         |  |                          |         |                  |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung                                   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|--|--------------------------|---------|--------------------|------------------------------|
| <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>   |                          |         |                   |                              | <b>USA</b>                                     |                          |         |                    |                              |
| <b>USA</b>  |                          |         |                   |                              | VERIZON COMMUNICATIONS                         |                          |         |                    |                              |
| ASSET BACKED FUNDING  |                          |         |                   |                              | 2,35 % 23.03.28                                | 440.000                  | AUD     | 260.853            | 0,69                         |
| 4,18 % 25.03.33   | 7.500.000                | USD     | 107.491           | 0,29                         |  |                          |         | <b>260.853</b>     | <b>0,69</b>                  |
| FNMA 1,50 % TBA 15.04.2036  | 220.000                  | USD     | 190.799           | 0,51                         | <b>SUMME ANLEIHEN</b>                          |                          |         | <b>311.863</b>     | <b>0,83</b>                  |
| FNMA 1,50 % TBA 15.04.51  | 230.000                  | USD     | 173.553           | 0,46                         | <b>SUMME SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |                          |         | <b>311.863</b>     | <b>0,83</b>                  |
| FNMA 2,50 % TBA 15.04.2036  | 270.000                  | USD     | 245.820           | 0,66                         | <b>SUMME WERTPAPIERANLAGEN</b>                 |                          |         | <b>41.206.595</b>  | <b>109,90</b>                |
| FNMA 3,00 % TBA 15.04.51  | 340.000                  | USD     | 293.343           | 0,77                         | <b>SONSTIGE NETTOVERBINDLICHKEITEN</b>         |                          |         | <b>(3.712.221)</b> | <b>(9,90)</b>                |
| FNMA 3,50 % TBA 15.04.51  | 220.000                  | USD     | 197.288           | 0,53                         | <b>GESAMTNETTOVERMÖGEN</b>                     |                          |         | <b>37.494.374</b>  | <b>100,00</b>                |
| FNMA 4,00 % TBA 15.04.51  | 160.000                  | USD     | 148.512           | 0,40                         |  |                          |         |                    |                              |
| FNMA 4,50 % TBA 15.04.51  | 60.000                   | USD     | 57.229            | 0,15                         |  |                          |         |                    |                              |
| FNMA 5,00 % TBA 15.04.35  | 70.000                   | USD     | 68.436            | 0,18                         |  |                          |         |                    |                              |
| FNMA 5,00 % TBA 15.04.2036  | 290.000                  | USD     | 288.940           | 0,76                         |  |                          |         |                    |                              |
| FNMA 6,00 % TBA 15.04.35  | 160.000                  | USD     | 161.645           | 0,43                         |  |                          |         |                    |                              |
| FNMA 6,50 % TBA 15.04.35  | 200.000                  | USD     | 204.467           | 0,55                         |  |                          |         |                    |                              |
| GINNIE MAE 2,00 % TBA 15.04.2051  | 270.000                  | USD     | 221.666           | 0,59                         |  |                          |         |                    |                              |
| GNMA 3,00 % TBA 15.04.2051  | 190.000                  | USD     | 167.965           | 0,45                         |  |                          |         |                    |                              |
| GNMA 3,50 % TBA 15.04.2051  | 230.000                  | USD     | 209.778           | 0,56                         |  |                          |         |                    |                              |
| GNMA 4,00 % TBA 15.04.2051  | 170.000                  | USD     | 159.495           | 0,43                         |  |                          |         |                    |                              |
| GNMA 4,50 % TBA 15.04.49  | 30.000                   | USD     | 28.857            | 0,08                         |  |                          |         |                    |                              |
| GNMA 5,50 % TBA 15.04.54  | 100.000                  | USD     | 100.003           | 0,27                         |  |                          |         |                    |                              |
|   |                          |         | <b>3.025.287</b>  | <b>8,07</b>                  |  |                          |         |                    |                              |
| <b>SUMME FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>   |                          |         | <b>3.025.287</b>  | <b>8,07</b>                  |  |                          |         |                    |                              |
| <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN<br/>MARKT GEHANDELTEN ÜBERTRAGBAREN<br/>WERTPAPIERE</b> |                          |         | <b>12.873.187</b> | <b>34,33</b>                 |  |                          |         |                    |                              |
| <b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>  |                          |         |                   |                              |  |                          |         |                    |                              |
| <b>IRLAND</b>   |                          |         |                   |                              |  |                          |         |                    |                              |
| HSBC US DOLLAR ESG<br>LIQUIDITY FUND Y INC  | 508.062                  | USD     | 508.062           | 1,36                         |  |                          |         |                    |                              |
|   |                          |         | <b>508.062</b>    | <b>1,36</b>                  |  |                          |         |                    |                              |
| <b>LUXEMBURG</b>  |                          |         |                   |                              |  |                          |         |                    |                              |
| HGIF GLOBAL ASSET-BACKED<br>CROSSOVER BOND  | 223.866                  | USD     | 2.090.017         | 5,57                         |  |                          |         |                    |                              |
|   |                          |         | <b>2.090.017</b>  | <b>5,57</b>                  |  |                          |         |                    |                              |
| <b>SUMME ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>  |                          |         | <b>2.598.079</b>  | <b>6,93</b>                  |  |                          |         |                    |                              |
| <b>SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>  |                          |         |                   |                              |  |                          |         |                    |                              |
| <b>ANLEIHEN</b>   |                          |         |                   |                              |  |                          |         |                    |                              |
| <b>AUSTRALIEN</b>   |                          |         |                   |                              |  |                          |         |                    |                              |
| SGSP AUSTRALIA ASSETS<br>1,843 % 15.09.28   | 90.000                   | AUD     | 51.010            | 0,14                         |  |                          |         |                    |                              |
|   |                          |         | <b>51.010</b>     | <b>0,14</b>                  |  |                          |         |                    |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Bond Total Return

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung                  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|------------------|------------------------------|-------------------------------|--------------------------|---------|----------|------------------------------|
| <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>  |                          |         |                  |                              | <b>BANQUE STELLANTIS</b>      |                          |         |          |                              |
| <b>AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |                          |         |                  |                              | FRANCE 4 % 21.01.27           |                          |         |          |                              |
| <b>ANLEIHEN</b>   |                          |         |                  |                              | 1.800.000 EUR 1.966.234 0,90  |                          |         |          |                              |
| <b>AUSTRALIEN</b>   |                          |         |                  |                              | BNP PARIBAS 4,75 % VRN        |                          |         |          |                              |
| TRANSURBAN FINANCE  |                          |         |                  |                              | 13.11.32                      |                          |         |          |                              |
| 3,713 % 12.03.32  | 558.000                  | EUR     | 609.173          | 0,28                         | 1.600.000 EUR 1.836.647 0,83  |                          |         |          |                              |
| TRANSURBAN FINANCE  |                          |         |                  |                              | CREDIT AGRICOLE 4,125 %       |                          |         |          |                              |
| 3,974 % 12.03.36  | 469.000                  | EUR     | 513.818          | 0,23                         | 26.02.36                      |                          |         |          |                              |
|   |                          |         | <b>1.122.991</b> | <b>0,51</b>                  | 900.000 EUR 1.000.935 0,45    |                          |         |          |                              |
| <b>BELGIEN</b>  |                          |         |                  |                              | CREDIT AGRICOLE 6,5 %         |                          |         |          |                              |
| KBC GROUP 6,151 % VRN   |                          |         |                  |                              | VRN PERP                      |                          |         |          |                              |
| 19.03.34  | 800.000                  | GBP     | 1.018.640        | 0,47                         | 1.200.000 EUR 1.318.282 0,60  |                          |         |          |                              |
| SOLVAY 4,25 % 03.10.31  | 600.000                  | EUR     | 646.633          | 0,29                         | CREDIT AGRICOLE 6,875 %       |                          |         |          |                              |
|   |                          |         | <b>1.665.273</b> | <b>0,76</b>                  | VRN PERP                      |                          |         |          |                              |
| <b>KANADA</b>   |                          |         |                  |                              | ELECTRICITE DE FRANCE         |                          |         |          |                              |
| ALIMENTATION COUCHE   |                          |         |                  |                              | 400.000 EUR 378.802 0,17      |                          |         |          |                              |
| 3,647 % 12.05.31  | 438.000                  | EUR     | 474.996          | 0,22                         | ELECTRICITE DE FRANCE         |                          |         |          |                              |
| ALIMENTATION COUCHETARD   |                          |         |                  |                              | 5,875 % VRN PERP              |                          |         |          |                              |
| 4,011 % 12.02.36  | 309.000                  | EUR     | 336.109          | 0,15                         | ELECTRICITE DE FRANCE         |                          |         |          |                              |
|   |                          |         | <b>811.105</b>   | <b>0,37</b>                  | 6 % VRN PERP                  |                          |         |          |                              |
| <b>CHILE</b>  |                          |         |                  |                              | ELIS 3,75 % 21.03.30          |                          |         |          |                              |
| CORP NACIONAL DEL COBRE   |                          |         |                  |                              | 900.000 EUR 969.522 0,44      |                          |         |          |                              |
| 5,125 % 02.02.33  | 600.000                  | USD     | 570.820          | 0,25                         | LA POSTE 3,125 % VRN          |                          |         |          |                              |
| CORP NACIONAL DEL COBRE   |                          |         |                  |                              | PERP                          |                          |         |          |                              |
| DE CHILE 6,44 % 26.01.36  | 353.000                  | USD     | 364.965          | 0,17                         | 1.700.000 EUR 1.787.147 0,81  |                          |         |          |                              |
|   |                          |         | <b>935.785</b>   | <b>0,42</b>                  | ORANGE 1,375 % VRN PERP       |                          |         |          |                              |
| <b>DÄNEMARK</b>   |                          |         |                  |                              | 02/10/2029                    |                          |         |          |                              |
| DANSKE BANK 3,875 % VRN   |                          |         |                  |                              | 800.000 EUR 744.475 0,34      |                          |         |          |                              |
| 09/01/2032  | 780.000                  | EUR     | 845.078          | 0,38                         | 1.409.000 EUR 1.592.435 0,72  |                          |         |          |                              |
|   |                          |         | <b>845.078</b>   | <b>0,38</b>                  | TELEPERFORMANCE 5,75 %        |                          |         |          |                              |
| <b>FINNLAND</b>   |                          |         |                  |                              | 22.11.31                      |                          |         |          |                              |
| BALDER FINLAND 2 %  |                          |         |                  |                              | 800.000 EUR 907.408 0,41      |                          |         |          |                              |
| 18.01.31  | 520.000                  | EUR     | 456.141          | 0,21                         | VEOLIA ENVIRONNEMENT          |                          |         |          |                              |
| TEOLLISUUDEN VOIMA  |                          |         |                  |                              | 2,5 % VRN PERP                |                          |         |          |                              |
| 4,75 % 01.06.30   | 528.000                  | EUR     | 595.468          | 0,27                         | WPP FINANCE 4,125 %           |                          |         |          |                              |
|   |                          |         | <b>1.051.609</b> | <b>0,48</b>                  | 30.05.28                      |                          |         |          |                              |
| <b>FRANKREICH</b>   |                          |         |                  |                              | 432.000 EUR 476.503 0,22      |                          |         |          |                              |
| ACCOR 3,875 % 11.03.31  | 1.000.000                | EUR     | 1.090.158        | 0,49                         | <b>21.069.698</b> <b>9,56</b> |                          |         |          |                              |
| ALD 4,875 % 06.10.28  | 900.000                  | EUR     | 1.018.438        | 0,46                         | <b>DEUTSCHLAND</b>            |                          |         |          |                              |
| AXA 3,941 % VRN PERP  | 900.000                  | EUR     | 967.515          | 0,44                         | BUNDESobligation 2,1 %        |                          |         |          |                              |
| BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT                                       |                          |         |                  |                              | 12/04/2029                    |                          |         |          |                              |
| MUTUEL 3,75 % 03.02.34  | 900.000                  | EUR     | 986.003          | 0,45                         | 3.790.000 EUR 4.051.453 1,84  |                          |         |          |                              |
| BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT                                       |                          |         |                  |                              | DEUTSCHE BANK 10 % VRN        |                          |         |          |                              |
| MUTUEL 4,75 % 10.11.31  | 800.000                  | EUR     | 920.298          | 0,42                         | PERP                          |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                  |                              | 800.000 EUR 939.194 0,43      |                          |         |          |                              |
| <b>GROSSBRITANNIEN</b>  |                          |         |                  |                              | EUROGRID 3,915 %              |                          |         |          |                              |
| ACCOR 3,875 % 11.03.31  | 1.000.000                | EUR     | 1.090.158        | 0,49                         | 01/02/2034                    |                          |         |          |                              |
| ALD 4,875 % 06.10.28  | 900.000                  | EUR     | 1.018.438        | 0,46                         | 700.000 EUR 772.026 0,35      |                          |         |          |                              |
| AXA 3,941 % VRN PERP  | 900.000                  | EUR     | 967.515          | 0,44                         | <b>5.762.673</b> <b>2,62</b>  |                          |         |          |                              |
| BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT                                       |                          |         |                  |                              | <b>GROSSBRITANNIEN</b>        |                          |         |          |                              |
| MUTUEL 3,75 % 03.02.34  | 900.000                  | EUR     | 986.003          | 0,45                         | ANGLO AMERICAN CAPITAL        |                          |         |          |                              |
| BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT                                       |                          |         |                  |                              | 3,375 % 11.03.29              |                          |         |          |                              |
| MUTUEL 4,75 % 10.11.31  | 800.000                  | EUR     | 920.298          | 0,42                         | 500.000 GBP 581.935 0,26      |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                  |                              | BARCLAYS 5,851 % VRN          |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                  |                              | 21.03.35                      |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                  |                              | 889.000 GBP 1.138.941 0,52    |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                  |                              | BARCLAYS 7,09 % VRN           |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                  |                              | 06/11/2029                    |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                  |                              | 385.000 GBP 518.122 0,23      |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                  |                              | BARCLAYS 9,25 % VRN           |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                  |                              | PERP                          |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                  |                              | 250.000 GBP 326.650 0,15      |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                  |                              | BARCLAYS 9,625 % VRN          |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                  |                              | PERP                          |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                  |                              | 319.000 USD 339.472 0,15      |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                  |                              | BP CAPITAL MARKETS            |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                  |                              | 4,375 % VRN PERP              |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                  |                              | 28.000 USD 27.519 0,01        |                          |         |          |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Bond Total Return (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|--|--------------------------|---------|------------------|------------------------------|
| HEATHROW FUNDING 6 %<br>05/03/2032                      | 688.000                  | GBP     | 880.839           | 0,40                         | <b>ITALIEN</b>   |                          |         |                  |                              |
| HSBC HOLDINGS 8,201 %<br>VRN 16.11.34                   | 646.000                  | GBP     | 899.831           | 0,41                         | ENEL 4,75 % VRN PERP                                   | 1.352.000                | EUR     | 1.451.850        | 0,66                         |
| NATIONAL GRID PLC<br>5,602 % 12.06.28                   | 153.000                  | USD     | 156.127           | 0,07                         | ENI 3,375 % VRN PERP                                   | 816.000                  | EUR     | 819.185          | 0,37                         |
| NATIONWIDE BUILDING<br>SOCIETY 6,557 % VRN<br>18.10.27  | 1.303.000                | USD     | 1.337.783         | 0,62                         | ITALGAS SPA 3,125 %<br>08/02/2029                      | 1.578.000                | EUR     | 1.677.309        | 0,76                         |
| NGG FINANCE 5,625 % VRN<br>18.06.73                     | 900.000                  | GBP     | 1.126.831         | 0,51                         |  |                          |         | <b>3.948.344</b> | <b>1,79</b>                  |
| OMNICOM FINANCE<br>HOLDINGS 3,7 % 06.03.32              | 820.000                  | EUR     | 890.863           | 0,40                         | <b>LUXEMBURG</b>                                       |                          |         |                  |                              |
| ROYAL BANK OF SCOTLAND<br>GROUP 3,622 % VRN<br>14.08.30 | 2.715.000                | GBP     | 3.329.598         | 1,52                         | AROUNDTOWN 1,625 % VRN<br>PERP                         | 1.100.000                | EUR     | 577.635          | 0,26                         |
| STANDARD CHARTERED<br>6,301 % VRN 09.01.29              | 1.289.000                | USD     | 1.326.046         | 0,60                         | AROUNDTOWN 2,875 % VRN<br>PERP                         | 840.000                  | EUR     | 474.110          | 0,22                         |
| VIRGIN MONEY 4 % VRN<br>18.03.28                        | 430.000                  | EUR     | 466.297           | 0,21                         | LOGICOR FINANCING<br>4,625 % 25.07.28                  | 640.000                  | EUR     | 699.897          | 0,31                         |
| VIRGIN MONEY 8,25 % VRN<br>PERP                         | 250.000                  | GBP     | 318.118           | 0,14                         |  |                          |         | <b>1.751.642</b> | <b>0,79</b>                  |
| VIRGIN MONEY UK 2,625 %<br>VRN 19.08.31                 | 210.000                  | GBP     | 245.994           | 0,11                         | <b>MEXIKO</b>  |                          |         |                  |                              |
| VODAFONE GROUP 4,875 %<br>VRN 03.10.78                  | 350.000                  | GBP     | 435.222           | 0,20                         | MEXICO (GOVT) 4,4899 %<br>25.05.32                     | 1.650.000                | EUR     | 1.814.753        | 0,82                         |
| WPP FINANCE 3,625 %<br>12/09/2029                       | 855.000                  | EUR     | 924.126           | 0,42                         | MEXICO (GOVT) 7,75 %<br>13.11.42                       | 466.000                  | MXN     | 2.393.495        | 1,09                         |
| WPP FINANCE 4 %<br>12/09/2033                           | 660.000                  | EUR     | 716.196           | 0,32                         |  |                          |         | <b>4.208.248</b> | <b>1,91</b>                  |
|   |                          |         | <b>15.986.510</b> | <b>7,25</b>                  | <b>MAROKKO</b>   |                          |         |                  |                              |
| <b>HONGKONG</b>   |                          |         |                   |                              | MOROCCO (GOVT) 5,95 %<br>08/03/2028                    | 871.000                  | USD     | 881.903          | 0,40                         |
| STUDIO CITY FINANCE 5 %<br>15.01.29                     | 959.000                  | USD     | 845.305           | 0,38                         |  |                          |         | <b>881.903</b>   | <b>0,40</b>                  |
|   |                          |         | <b>845.305</b>    | <b>0,38</b>                  | <b>NIEDERLANDE</b>                                     |                          |         |                  |                              |
| <b>UNGARN</b>   |                          |         |                   |                              | ASR NEDERLAND 3,625 %<br>12/12/2028                    | 304.000                  | EUR     | 329.212          | 0,15                         |
| HUNGARY (GOVT) 4 %<br>25.07.29                          | 607.000                  | EUR     | 654.703           | 0,30                         | CTP 4,75 % 05.02.30                                    | 406.000                  | EUR     | 445.109          | 0,20                         |
|   |                          |         | <b>654.703</b>    | <b>0,30</b>                  | GENERALI FINANCE 4,596 %<br>VRN PERP                   | 100.000                  | EUR     | 108.504          | 0,05                         |
| <b>INDONESIEN</b>                                       |                          |         |                   |                              | PETROBRAS GLOBAL<br>FINANCE 5,093 % 15.01.30           | 500                      | USD     | 477              | 0,00                         |
| INDONESIA (GOVT) 1,1 %<br>12/03/2033                    | 468.000                  | EUR     | 401.765           | 0,18                         | RELX FINANCE 3,375 %<br>20.03.33                       | 1.118.000                | EUR     | 1.211.398        | 0,55                         |
|   |                          |         | <b>401.765</b>    | <b>0,18</b>                  | SWISS LIFE 4,5 % VRN<br>PERP                           | 975.000                  | EUR     | 1.054.986        | 0,48                         |
| <b>IRLAND</b>   |                          |         |                   |                              | TELEFONICA EUROPE 6,75 %<br>VRN PERP                   | 400.000                  | EUR     | 469.314          | 0,21                         |
| AVOLON HOLDINGS FUNDING<br>5,75 % 01.03.29              | 1.767.000                | USD     | 1.762.595         | 0,80                         |  |                          |         | <b>3.619.000</b> | <b>1,64</b>                  |
| CA AUTO BANK<br>6 % 06.12.26                            | 1.505.000                | GBP     | 1.930.680         | 0,87                         | <b>NEUSEELAND</b>                                      |                          |         |                  |                              |
|   |                          |         | <b>3.693.275</b>  | <b>1,67</b>                  | NEW ZEALAND (GOVT) 3,5 %<br>14.04.33                   | 10.000.000               | NZD     | 5.524.528        | 2,51                         |
| <b>ISRAEL</b>   |                          |         |                   |                              |  |                          |         | <b>5.524.528</b> | <b>2,51</b>                  |
| ENERGEAN ISRAEL FINANCE<br>8,5 % 30.09.33               | 940.000                  | USD     | 932.362           | 0,42                         | <b>POLEN</b>   |                          |         |                  |                              |
|   |                          |         | <b>932.362</b>    | <b>0,42</b>                  | REPUBLIC OF POLAND<br>GOVERNMENT I 5,125 %<br>18.09.34 | 2.200.000                | USD     | 2.196.046        | 1,00                         |
|   |                          |         |                   |                              |  |                          |         | <b>2.196.046</b> | <b>1,00</b>                  |
|   |                          |         |                   |                              | <b>PORTUGAL</b>  |                          |         |                  |                              |
|   |                          |         |                   |                              | EDP ENERGIAS DE<br>PORTUGAL 1,7 % VRN<br>20.07.80      | 1.000.000                | EUR     | 1.041.477        | 0,47                         |
|   |                          |         |                   |                              |  |                          |         | <b>1.041.477</b> | <b>0,47</b>                  |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Bond Total Return (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|------------------|------------------------------|--|--------------------------|---------|--------------------|------------------------------|
| <b>SPANIEN</b>  |                          |         |                  |                              | FISERV 5,375 % 21.08.28  | 857.000                  | USD     | 866.640            | 0,39                         |
| BANCO SANTANDER 5,538 %<br>VRN 14.03.30                 | 1.600.000                | USD     | 1.600.746        | 0,72                         | FORD MOTOR CREDIT<br>6,798 % 07.11.28                                | 359.000                  | USD     | 374.905            | 0,17                         |
| BANCO SANTANDER 6,607 %<br>07/11/2028                   | 600.000                  | USD     | 635.147          | 0,29                         | FORD MOTOR CREDIT 7,2 %<br>10/06/2030                                | 1.181.000                | USD     | 1.255.921          | 0,57                         |
| CAIXABANK 4,25 %<br>06/09/2030                          | 700.000                  | EUR     | 787.681          | 0,36                         | FORD MOTOR CREDIT 7,35 %<br>06/03/2030                               | 700.000                  | USD     | 747.257            | 0,34                         |
| CAIXABANK 7,5 % VRN PERP                                | 600.000                  | EUR     | 673.440          | 0,31                         | GENERAL MOTORS<br>FINANCIAL 4,3 % 15.02.29                           | 773.000                  | EUR     | 859.576            | 0,39                         |
| CELLNEX FINANCE 1,5 %<br>08/06/2028                     | 1.400.000                | EUR     | 1.390.909        | 0,63                         | GENERAL MOTORS<br>FINANCIAL 6,1 % 07.01.34                           | 1.100.000                | USD     | 1.131.264          | 0,51                         |
| IBERDROLA FINANZAS<br>4,871 % VRN PERP                  | 800.000                  | EUR     | 873.239          | 0,40                         | GLOBAL PAYMENTS 4,875 %<br>17.03.31                                  | 919.000                  | EUR     | 1.048.340          | 0,48                         |
|   |                          |         | <b>5.961.162</b> | <b>2,71</b>                  | GLOBAL PAYMENTS 5,3 %<br>15.08.29                                    | 750.000                  | USD     | 748.046            | 0,34                         |
| <b>SCHWEDEN</b>   |                          |         |                  |                              | MORGAN STANLEY 3,955 %<br>VRN 21.03.35                               | 1.525.000                | EUR     | 1.673.232          | 0,76                         |
| AKELIUS RESIDENTIAL<br>PROPERTY 2,249 % VRN<br>17.05.81 | 750.000                  | EUR     | 743.345          | 0,34                         | MORGAN STANLEY 5,449 %<br>VRN 20.07.29                               | 247.000                  | USD     | 249.447            | 0,11                         |
| MOLNLYCKE HOLDING 4,25 %<br>08/09/2028                  | 835.000                  | EUR     | 919.646          | 0,41                         | OCCIDENTAL PETROLEUM<br>6,625 % 01.09.30                             | 731.000                  | USD     | 774.884            | 0,35                         |
|   |                          |         | <b>1.662.991</b> | <b>0,75</b>                  | REALTY INCOME 5,75 %<br>05/12/2031                                   | 511.000                  | GBP     | 669.002            | 0,30                         |
| <b>SCHWEIZ</b>  |                          |         |                  |                              |  |                          |         | <b>22.940.207</b>  | <b>10,40</b>                 |
| UBS AGLONDON 5,65 %<br>11/09/2028                       | 1.400.000                | USD     | 1.435.647        | 0,65                         | <b>SUMME ANLEIHEN</b>  |                          |         | <b>114.154.634</b> | <b>51,77</b>                 |
| UBS GROUP 4,125 % VRN<br>09/06/2033                     | 592.000                  | EUR     | 650.146          | 0,29                         | <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>                              |                          |         |                    |                              |
| UBS GROUP 7,75 % VRN<br>PERP                            | 661.000                  | USD     | 681.094          | 0,31                         | <b>IRLAND</b>  |                          |         |                    |                              |
| UBS GROUP 9,25 % VRN<br>PERP                            | 324.000                  | USD     | 351.539          | 0,16                         | FINANCE IRELAND RMBS<br>DAC FRN 24.12.2061                           | 1.280.000                | EUR     | 1.370.516          | 0,63                         |
|   |                          |         | <b>3.118.426</b> | <b>1,41</b>                  | HARVEST CLO FRN<br>20.10.2032 (XS2112471185)                         | 1.000.000                | EUR     | 1.061.313          | 0,48                         |
| <b>VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE</b>                     |                          |         |                  |                              | TAURUS DAC FRN<br>17.08.31   | 1.500.000                | GBP     | 1.196.480          | 0,54                         |
| FIRST ABU DHABI BANK<br>5 % 28.02.29                    | 1.529.000                | USD     | 1.522.528        | 0,69                         |  |                          |         | <b>3.628.309</b>   | <b>1,65</b>                  |
|   |                          |         | <b>1.522.528</b> | <b>0,69</b>                  | <b>LUXEMBURG</b>   |                          |         |                    |                              |
| <b>USA</b>  |                          |         |                  |                              | SC GERMANY COMPARTMENT<br>CONSUME FRN 14.11.2034                     | 2.300.000                | EUR     | 749.020            | 0,34                         |
| AIR LEASE 3,7 % 15.04.2030                              | 1.732.000                | EUR     | 1.864.605        | 0,85                         |  |                          |         | <b>749.020</b>     | <b>0,34</b>                  |
| AIRCASTLE 6,5 % 18.07.2028                              | 1.908.000                | USD     | 1.946.487        | 0,88                         | <b>USA</b>   |                          |         |                    |                              |
| AMERICAN TOWER 4,625 %<br>16.05.31                      | 552.000                  | EUR     | 626.704          | 0,28                         | CONNECTICUT AVENUE<br>SECURITIES FRN 25.12.2041                      | 1.225.000                | USD     | 1.235.047          | 0,56                         |
| BANK OF AMERICA 5,526 %<br>18.08.26                     | 2.100.000                | USD     | 2.123.115        | 0,96                         |  |                          |         | <b>1.235.047</b>   | <b>0,56</b>                  |
| CARRIER GLOBAL 4,5 %<br>29.11.32                        | 1.341.000                | EUR     | 1.538.447        | 0,70                         | <b>SUMME FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>                        |                          |         | <b>5.612.376</b>   | <b>2,55</b>                  |
| CNH INDUSTRIAL CAPITAL<br>4,55 % 10.04.28               | 674.000                  | USD     | 661.303          | 0,30                         | <b>SUMME DER AN EINER GEREGELTEN<br/>BÖRSE NOTIERTEN WERTPAPIERE</b> |                          |         |                    |                              |
| CNH INDUSTRIAL CAPITAL<br>5,1 % 20.04.29                | 1.625.000                | USD     | 1.621.846        | 0,74                         |  |                          |         | <b>119.767.010</b> | <b>54,32</b>                 |
| DIGITAL EURO FINCO<br>2,625 % 15.04.24                  | 1.123.000                | EUR     | 1.212.100        | 0,55                         | <b>WERTPAPIERE</b>   |                          |         |                    |                              |
| DOW CHEMICAL 5,15 %<br>15.02.34                         | 950.000                  | USD     | 947.086          | 0,43                         |  |                          |         |                    |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Bond Total Return (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung                 | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--------------------------|---------|------------------|------------------------------|------------------------------|--------------------------|---------|-----------|------------------------------|
| <b>AN EINEM ANDEREM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE, ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |                          |         |                  |                              | <b>GRAND CITY PROPERTIES</b> |                          |         |           |                              |
| <b>ANLEIHEN</b>  |                          |         |                  |                              | 1,5 % VRN PERP               |                          |         |           |                              |
| <b>CHILE</b>   |                          |         |                  |                              | LOGICOR FINANCING SARL       |                          |         |           |                              |
| EMPRESA NACIONAL DEL   |                          |         |                  |                              | 1,625 % 17.01.30             | 1.572.000                | EUR     | 1.471.618 | 0,67                         |
| PETROLEO 3,45 % 16.09.31   | 1.075.000                | USD     | 918.842          | 0,42                         | MEXICO REMITTANCES           |                          |         |           |                              |
|  |                          |         | <b>918.842</b>   | <b>0,42</b>                  | FUNDING 4,875 % 15.01.2028   | 3.340.000                | USD     | 2.396.750 | 1,09                         |
| <b>KOLUMBIEN</b>   |                          |         |                  |                              | <b>MACAU</b>                 |                          |         |           |                              |
| COLOMBIA (GOVT) 3,125 %  |                          |         |                  |                              | SANDS CHINA 5,4 %            |                          |         |           |                              |
| 15.04.31   | 1.200.000                | USD     | 961.501          | 0,44                         | 08/08/2028                   |                          |         |           |                              |
|  |                          |         | <b>961.501</b>   | <b>0,44</b>                  | 1.245.000                    |                          |         |           |                              |
| <b>DEUTSCHLAND</b>   |                          |         |                  |                              | USD                          |                          |         |           |                              |
| DEUTSCHE BANK 4 % VRN  |                          |         |                  |                              | 1.221.814                    |                          |         |           |                              |
| 24.06.32   | 900.000                  | EUR     | 942.810          | 0,43                         | <b>1.221.814</b>             |                          |         |           |                              |
| EON 3,5 % 25.03.32   | 2.140.000                | EUR     | 2.319.160        | 1,05                         | <b>0,55</b>                  |                          |         |           |                              |
|  |                          |         | <b>3.261.970</b> | <b>1,48</b>                  | <b>MAURITIUS</b>             |                          |         |           |                              |
| <b>GROSSBRITANNIEN</b>   |                          |         |                  |                              | NETWORK 5,65 % VRN PERP      |                          |         |           |                              |
| ANGLO AMERICAN CAPITAL   |                          |         |                  |                              | 400.000                      |                          |         |           |                              |
| 4,125 % 15.03.32   | 1.305.000                | EUR     | 1.415.251        | 0,63                         | USD                          |                          |         |           |                              |
| BARCLAYS 8,875 % VRN   |                          |         |                  |                              | 397.209                      |                          |         |           |                              |
| PERP   | 424.000                  | GBP     | 546.396          | 0,25                         | <b>397.209</b>               |                          |         |           |                              |
| BERKELEY GROUP 2,5 %   |                          |         |                  |                              | <b>0,18</b>                  |                          |         |           |                              |
| 11/08/2031   | 461.000                  | GBP     | 452.241          | 0,21                         | <b>MEXIKO</b>                |                          |         |           |                              |
| LLOYDS BANKING GROUP   |                          |         |                  |                              | ORBIT ADVANCE 2,875 %        |                          |         |           |                              |
| 8,5 % VRN PERP   | 750.000                  | GBP     | 968.368          | 0,44                         | 11/05/2031                   |                          |         |           |                              |
| MACQUARIE AIRFINANCE   |                          |         |                  |                              | 800.000                      |                          |         |           |                              |
| HOLDINGS 6,5 % 26.03.31  | 1.042.000                | USD     | 1.061.970        | 0,48                         | USD                          |                          |         |           |                              |
| ROTHESAY LIFE 5 % VRN  |                          |         |                  |                              | 664.330                      |                          |         |           |                              |
| PERP   | 466.000                  | GBP     | 453.305          | 0,21                         | <b>664.330</b>               |                          |         |           |                              |
| ROTHESAY LIFE 5,5 % VRN  |                          |         |                  |                              | <b>0,30</b>                  |                          |         |           |                              |
| 17.09.29   | 502.000                  | GBP     | 631.272          | 0,29                         | <b>NIEDERLANDE</b>           |                          |         |           |                              |
|  |                          |         | <b>5.528.803</b> | <b>2,51</b>                  | FERROVIAL 4,375 %            |                          |         |           |                              |
| <b>INDIEN</b>  |                          |         |                  |                              | 13.09.30                     |                          |         |           |                              |
| HDFC BANK 5,18 %   |                          |         |                  |                              | 1.607.000                    |                          |         |           |                              |
| 15.02.29   | 3.000.000                | USD     | 2.985.493        | 1,35                         | EUR                          |                          |         |           |                              |
|  |                          |         | <b>2.985.493</b> | <b>1,35</b>                  | 1.808.993                    |                          |         |           |                              |
| <b>IRLAND</b>  |                          |         |                  |                              | 0,82                         |                          |         |           |                              |
| AVOLON HOLDINGS FUNDING  |                          |         |                  |                              | 1.300.000                    |                          |         |           |                              |
| 4,25 % 15.04.26  | 32.000                   | USD     | 30.928           | 0,01                         | EUR                          |                          |         |           |                              |
| SMURFIT KAPPA TREASURY   |                          |         |                  |                              | 1.337.534                    |                          |         |           |                              |
| 5,2 % 15.01.30   | 708.000                  | USD     | 707.494          | 0,32                         | EUR                          |                          |         |           |                              |
|  |                          |         | <b>738.422</b>   | <b>0,33</b>                  | 726.070                      |                          |         |           |                              |
| <b>ITALIEN</b>   |                          |         |                  |                              | <b>3.872.597</b>             |                          |         |           |                              |
| ENI 4,25 % 19.05.33  | 646.000                  | EUR     | 728.984          | 0,33                         | <b>1,76</b>                  |                          |         |           |                              |
| UNIONE DI BANCHE   |                          |         |                  |                              | <b>SPANIEN</b>               |                          |         |           |                              |
| ITALIANE 5,875 % VRN PERP  | 780.000                  | EUR     | 840.857          | 0,38                         | CAIXABANK 5,673 % VRN        |                          |         |           |                              |
|  |                          |         | <b>1.569.841</b> | <b>0,71</b>                  | 15.03.30                     |                          |         |           |                              |
| <b>LUXEMBURG</b>   |                          |         |                  |                              | 1.223.000                    |                          |         |           |                              |
| BLACKSTONE PROPERTY  |                          |         |                  |                              | USD                          |                          |         |           |                              |
| PARTNERS 2,625 %   |                          |         |                  |                              | 1.223.290                    |                          |         |           |                              |
| 20.10.28   | 1.348.000                | GBP     | 1.481.761        | 0,67                         | <b>1.223.290</b>             |                          |         |           |                              |
|  |                          |         |                  |                              | <b>0,55</b>                  |                          |         |           |                              |
|  |                          |         |                  |                              | <b>USA</b>                   |                          |         |           |                              |
|  |                          |         |                  |                              | AIRCATTLE 5,25 %             |                          |         |           |                              |
|  |                          |         |                  |                              | 11/08/2025                   |                          |         |           |                              |
|  |                          |         |                  |                              | 1.910.000                    |                          |         |           |                              |
|  |                          |         |                  |                              | USD                          |                          |         |           |                              |
|  |                          |         |                  |                              | 1.893.270                    |                          |         |           |                              |
|  |                          |         |                  |                              | 0,86                         |                          |         |           |                              |
|  |                          |         |                  |                              | ASHTREAD CAPITAL 4,25 %      |                          |         |           |                              |
|  |                          |         |                  |                              | 01/11/2029                   |                          |         |           |                              |
|  |                          |         |                  |                              | 1.600.000                    |                          |         |           |                              |
|  |                          |         |                  |                              | USD                          |                          |         |           |                              |
|  |                          |         |                  |                              | 1.493.425                    |                          |         |           |                              |
|  |                          |         |                  |                              | 0,68                         |                          |         |           |                              |
|  |                          |         |                  |                              | AVOLON HOLDINGS FUNDING      |                          |         |           |                              |
|  |                          |         |                  |                              | 5,5 % 15.01.26               |                          |         |           |                              |
|  |                          |         |                  |                              | 800.000                      |                          |         |           |                              |
|  |                          |         |                  |                              | USD                          |                          |         |           |                              |
|  |                          |         |                  |                              | 792.949                      |                          |         |           |                              |
|  |                          |         |                  |                              | 0,36                         |                          |         |           |                              |
|  |                          |         |                  |                              | BAXTER INTERNATIONAL         |                          |         |           |                              |
|  |                          |         |                  |                              | 2,272 % 01.12.28             |                          |         |           |                              |
|  |                          |         |                  |                              | 1.150.000                    |                          |         |           |                              |
|  |                          |         |                  |                              | USD                          |                          |         |           |                              |
|  |                          |         |                  |                              | 1.014.060                    |                          |         |           |                              |
|  |                          |         |                  |                              | 0,46                         |                          |         |           |                              |
|  |                          |         |                  |                              | CAPITAL ONE FINANCIAL        |                          |         |           |                              |
|  |                          |         |                  |                              | 7,149 % VRN 29.10.27         |                          |         |           |                              |
|  |                          |         |                  |                              | 335.000                      |                          |         |           |                              |
|  |                          |         |                  |                              | USD                          |                          |         |           |                              |
|  |                          |         |                  |                              | 349.083                      |                          |         |           |                              |
|  |                          |         |                  |                              | 0,16                         |                          |         |           |                              |
|  |                          |         |                  |                              | CHENIERE ENERGY 5,65 %       |                          |         |           |                              |
|  |                          |         |                  |                              | 15.04.34                     |                          |         |           |                              |
|  |                          |         |                  |                              | 686.000                      |                          |         |           |                              |
|  |                          |         |                  |                              | USD                          |                          |         |           |                              |
|  |                          |         |                  |                              | 691.222                      |                          |         |           |                              |
|  |                          |         |                  |                              | 0,31                         |                          |         |           |                              |
|  |                          |         |                  |                              | COLUMBIA PIPELINES           |                          |         |           |                              |
|  |                          |         |                  |                              | HOLDING 6,042 % 15.08.28     |                          |         |           |                              |
|  |                          |         |                  |                              | 440.000                      |                          |         |           |                              |
|  |                          |         |                  |                              | USD                          |                          |         |           |                              |
|  |                          |         |                  |                              | 450.346                      |                          |         |           |                              |
|  |                          |         |                  |                              | 0,20                         |                          |         |           |                              |
|  |                          |         |                  |                              | DELTA AIR LINES 4,75 %       |                          |         |           |                              |
|  |                          |         |                  |                              | 20.10.28                     |                          |         |           |                              |
|  |                          |         |                  |                              | 1.669.412                    |                          |         |           |                              |
|  |                          |         |                  |                              | USD                          |                          |         |           |                              |
|  |                          |         |                  |                              | 1.633.524                    |                          |         |           |                              |
|  |                          |         |                  |                              | 0,74                         |                          |         |           |                              |
|  |                          |         |                  |                              | HCA 5,45 % 01.04.31          |                          |         |           |                              |
|  |                          |         |                  |                              | 660.000                      |                          |         |           |                              |
|  |                          |         |                  |                              | USD                          |                          |         |           |                              |
|  |                          |         |                  |                              | 664.729                      |                          |         |           |                              |
|  |                          |         |                  |                              | 0,30                         |                          |         |           |                              |
|  |                          |         |                  |                              | JACKSON NATIONAL LIFE        |                          |         |           |                              |
|  |                          |         |                  |                              | GLOBAL 5,25 % 12.04.28       |                          |         |           |                              |
|  |                          |         |                  |                              | 1.924.000                    |                          |         |           |                              |
|  |                          |         |                  |                              | USD                          |                          |         |           |                              |
|  |                          |         |                  |                              | 1.904.597                    |                          |         |           |                              |
|  |                          |         |                  |                              | 0,86                         |                          |         |           |                              |
|  |                          |         |                  |                              | MOHAWK INDUSTRIES 5,85 %     |                          |         |           |                              |
|  |                          |         |                  |                              | 18.09.28                     |                          |         |           |                              |
|  |                          |         |                  |                              | 510.000                      |                          |         |           |                              |
|  |                          |         |                  |                              | USD                          |                          |         |           |                              |
|  |                          |         |                  |                              | 525.790                      |                          |         |           |                              |
|  |                          |         |                  |                              | 0,24                         |                          |         |           |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Bond Total Return (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung                                       | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|--|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|
| NEXTERA ENERGY CAPITAL HOLDINGS 5,25 % 15.03.34       | 1.361.000                | USD     | 1.359.170         | 0,62                         | APIDOS CLO XXXIX FRN 21.04.35                      | 1.000.000                | USD     | 980.495           | 0,44                         |
| SYNCHRONY FINANCIAL 3,95 % 01.12.27                   | 500.000                  | USD     | 468.668           | 0,21                         | BBCMS MORTGAGE TRUST FRN 15.03.37                  | 1.000.000                | USD     | 887.844           | 0,40                         |
| US (GOVT) 4,25 % 28.02.29                             | 5.890.000                | USD     | 5.903.574         | 2,68                         | BF MORTGAGE TRUST FRN 15.12.35                     | 1.000.000                | USD     | 841.326           | 0,38                         |
| VERALTO 4,15 % 19.09.2031                             | 1.228.000                | EUR     | 1.364.344         | 0,62                         | BOYCE PARK CLO FRN 21.04.35                        | 1.000.000                | USD     | 993.171           | 0,45                         |
| WARNERMEDIA HOLDINGS 4,054 % 15.03.29                 | 609.000                  | USD     | 570.429           | 0,26                         | BX TRUST FRN 25.11.2028                            | 1.000.000                | USD     | 697.177           | 0,32                         |
| WEA FINANCE 2,875 % 15.01.27                          | 286.000                  | USD     | 262.798           | 0,12                         | CAMB COMMERCIAL MORTGAGE TRUST FRN 15.12.37        | 1.000.000                | USD     | 1.000.205         | 0,45                         |
| WEA FINANCE 3,5 % 15.06.29                            | 1.363.000                | USD     | 1.204.342         | 0,55                         | CIFC FUNDING FRN 17.10.31                          | 1.000.000                | USD     | 999.965           | 0,45                         |
|   |                          |         | <b>22.546.320</b> | <b>10,23</b>                 | COMMERCIAL MORTGAGE TRUST 2,321 % VRN 10/01/2038   | 1.000.000                | USD     | 844.055           | 0,38                         |
| <b>SUMME ANLEIHEN</b>                                 |                          |         | <b>52.008.523</b> | <b>23,59</b>                 | CONNECTICUT AVENUE SECURITIES TRUST FRN 25.02.44   | 500.000                  | USD     | 502.825           | 0,23                         |
| <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>               |                          |         |                   |                              | DBGS MORTGAGE TRUST FRN 15.05.35                   | 1.000.000                | USD     | 904.474           | 0,41                         |
| <b>GROSSBRITANNIEN</b>                                |                          |         |                   |                              | FREDDIE MAC FRN 25.08.33                           | 1.186.000                | USD     | 1.025.451         | 0,47                         |
| POLARIS FRN 23.12.2058                                | 1.000.000                | GBP     | 1.258.981         | 0,57                         | FREDDIE MAC STACR REMIC TRUST FRN 25.08.2033       | 1.000.000                | USD     | 877.995           | 0,40                         |
|   |                          |         | <b>1.258.981</b>  | <b>0,57</b>                  | GILBERT PARK CLO FRN 15.10.30                      | 1.000.000                | USD     | 1.002.151         | 0,45                         |
| <b>IRLAND</b>   |                          |         |                   |                              | HPS LOAN MANAGEMENT 15-2019 FRN 22.01.2035         | 1.000.000                | USD     | 964.775           | 0,44                         |
| CABINTEELY PARK CLO DAC FRN 15.08.34                  | 1.000.000                | EUR     | 1.059.431         | 0,48                         | HPS LOAN MANAGEMENT FRN 25.01.34                   | 1.000.000                | USD     | 967.966           | 0,44                         |
| CABINTEELY PARK CLO DAC FRN 15.08.2034 (XS2417672990) | 500.000                  | EUR     | 526.776           | 0,24                         | JP MORGAN CHASE COMMITMENTS 3,44957 % VRN 05.01.39 | 1.500.000                | USD     | 1.088.361         | 0,50                         |
| HAUS EUROPEAN LOAN CONDUIT FRN 30.07.2051             | 1.000.000                | EUR     | 917.735           | 0,42                         | PIKES PEAK CLO FRN 25.10.34                        | 1.000.000                | USD     | 981.131           | 0,44                         |
| INVESCO EURO CLO FRN 15.04.33                         | 1.000.000                | EUR     | 1.049.257         | 0,48                         | PROGRESS RESIDENTIAL 2,309 % 17.05.38              | 1.200.000                | USD     | 1.105.108         | 0,51                         |
| LAST MILE LOGISTIC FRN 17.08.33                       | 1.000.000                | EUR     | 1.016.981         | 0,46                         | PROGRESS RESIDENTIAL 5,2 % 17.04.39                | 1.000.000                | USD     | 958.850           | 0,43                         |
| LAST MILE SECURITIES DAC FRN 17.08.31                 | 500.000                  | EUR     | 523.341           | 0,24                         | PROGRESS RESIDENTIAL TRUST 3,378 % 17.01.39        | 1.000.000                | USD     | 878.856           | 0,40                         |
| ST PAULS CLO XII DAC FRN 15.04.33                     | 1.000.000                | EUR     | 1.067.265         | 0,48                         | WHETSTONE PARK CLO FRN 20.01.35                    | 1.000.000                | USD     | 967.417           | 0,44                         |
| TAURUS FRN 17.05.2031                                 | 1.100.000                | GBP     | 1.326.335         | 0,60                         |  |                          |         | <b>21.425.326</b> | <b>9,72</b>                  |
| VITA SCIENTIA DAC FRN 27.08.25                        | 600.000                  | EUR     | 600.826           | 0,27                         | <b>SUMME FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>      |                          |         | <b>32.328.705</b> | <b>14,66</b>                 |
| VITA SCIENTIA DAC FRN 27.08.2025 (XS2453862141)       | 500.000                  | EUR     | 490.509           | 0,22                         | <b>SUMME DER AN EINER GEREGELTEN</b>               |                          |         | <b>84.337.228</b> | <b>38,25</b>                 |
|   |                          |         | <b>8.578.456</b>  | <b>3,89</b>                  | <b>MARKT GEHANDELTEN ÜBERTRAGBAREN WERTPAPIERE</b> |                          |         |                   |                              |
| <b>NIEDERLANDE</b>                                    |                          |         |                   |                              |  |                          |         |                   |                              |
| JUBILEE CLO FRN 15.04.35                              | 1.000.000                | EUR     | 1.065.942         | 0,48                         |  |                          |         |                   |                              |
|   |                          |         | <b>1.065.942</b>  | <b>0,48</b>                  |  |                          |         |                   |                              |
| <b>USA</b>  |                          |         |                   |                              |  |                          |         |                   |                              |
| ALLEGANY PARK CLO FRN 20.01.35                        | 1.000.000                | USD     | 961.753           | 0,44                         |  |                          |         |                   |                              |
| APIDOS CLO XXXI FRN 15.04.31                          | 1.000.000                | USD     | 993.975           | 0,45                         |  |                          |         |                   |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Bond Total Return (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung                                   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--------------------------|---------|--------------------|------------------------------|
| <b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>       |                          |         |                    |                              |
| <b>IRLAND</b>                                  |                          |         |                    |                              |
| HSBC US DOLLAR ESG<br>LIQUIDITY FUND Y INC     | 4.037.320                | USD     | 4.037.321          | 1,83                         |
|  |                          |         | <b>4.037.321</b>   | <b>1,83</b>                  |
| <b>LUXEMBURG</b>                               |                          |         |                    |                              |
| HGIF ASIA HIGH YIELD<br>BOND „ZC“              | 527.810                  | USD     | 3.841.401          | 1,74                         |
|  |                          |         | <b>3.841.401</b>   | <b>1,74</b>                  |
| <b>SUMME ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b> |                          |         | <b>7.878.722</b>   | <b>3,57</b>                  |
| <b>SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>       |                          |         |                    |                              |
| <b>ANLEIHEN</b>                                |                          |         |                    |                              |
| <b>NIEDERLANDE</b>                             |                          |         |                    |                              |
| ASR NEDERLAND 4,625 %<br>VRN PERP              | 400.000                  | EUR     | 404.747            | 0,18                         |
|  |                          |         | <b>404.747</b>     | <b>0,18</b>                  |
| <b>SUMME ANLEIHEN</b>                          |                          |         | <b>404.747</b>     | <b>0,18</b>                  |
| <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>        |                          |         |                    |                              |
| <b>USA</b>                                     |                          |         |                    |                              |
| MADISON PARK FUNDING<br>FRN 21.07.30           | 1.000.000                | USD     | 1.000.083          | 0,46                         |
|  |                          |         | <b>1.000.083</b>   | <b>0,46</b>                  |
| <b>SUMME FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>  |                          |         | <b>1.000.083</b>   | <b>0,46</b>                  |
| <b>SUMME SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |                          |         | <b>1.404.830</b>   | <b>0,64</b>                  |
| <b>SUMME WERTPAPIERANLAGEN</b>                 |                          |         | <b>213.387.790</b> | <b>96,78</b>                 |
| <b>SONSTIGES NETTOVERMÖGEN</b>                 |                          |         | <b>7.110.231</b>   | <b>3,22</b>                  |
| <b>GESAMTNETTOVERMÖGEN</b>                     |                          |         | <b>220.498.021</b> | <b>100,00</b>                |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Corporate Bond

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung                 | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|------------------------------|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|
| <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>   |                          |         |                   |                              | <b>WASTE CONNECTIONS 5 %</b> |                          |         |                   |                              |
| <b>AN EINER GEREGELTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |                          |         |                   |                              | 01/03/2034                   |                          |         |                   |                              |
| <b>ANLEIHEN</b>  |                          |         |                   |                              | 17.575.000                   |                          |         |                   |                              |
| <b>AUSTRALIEN</b>  |                          |         |                   |                              | USD                          |                          |         |                   |                              |
| SCENTRE MANAGEMENT   |                          |         |                   |                              |                              |                          |         | 17.431.883        | 0,52                         |
| 3,875 % 16.07.26   | 1.072.000                | GBP     | 1.309.855         | 0,04                         |                              |                          |         | <b>88.282.480</b> | <b>2,66</b>                  |
| SYDNEY AIRPORT FINANCE   |                          |         |                   |                              | <b>DÄNEMARK</b>              |                          |         |                   |                              |
| 2,75 % 23.04.24  | 3.100.000                | EUR     | 3.345.603         | 0,10                         | DONG ENERGY 4,875 %          |                          |         |                   |                              |
| TOYOTA FINANCE AUSTRALIA   |                          |         |                   |                              | 12/01/2032                   |                          |         |                   |                              |
| 3,386 % 18.03.30   | 4.500.000                | EUR     | 4.882.751         | 0,14                         | 1.400.000                    |                          |         |                   |                              |
| TOYOTA FINANCE AUSTRALIA   |                          |         |                   |                              | JYSKE BANK 5,125 % VRN       |                          |         |                   |                              |
| 3,92 % 28.06.27  | 2.083.000                | GBP     | 2.574.936         | 0,08                         | 01/05/2035                   |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         | <b>12.113.145</b> | <b>0,36</b>                  | 8.000.000                    |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | ORSTED 5,375 % 13.09.42      |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 252.000                      |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | GBP                          |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 315.413                      |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | <b>10.902.399</b>            |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | <b>0,33</b>                  |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | <b>FINNLAND</b>              |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | NORDEA BANK 4,875 % VRN      |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 23.02.34                     |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 4.186.000                    |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | EUR                          |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 4.675.997                    |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 0,14                         |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | SAMPO 3,375 % VRN            |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 23.05.49                     |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 10.100.000                   |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | EUR                          |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 10.379.423                   |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 0,31                         |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | STORA ENSO 4,25 %            |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 01/09/2029                   |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 8.000.000                    |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | EUR                          |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 8.858.414                    |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 0,27                         |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | <b>23.913.834</b>            |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | <b>0,72</b>                  |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | <b>FRANKREICH</b>            |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | ALD 4,875 % 06.10.28         |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 11.000.000                   |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | EUR                          |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 12.447.574                   |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 0,37                         |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | APRR 1,5 % 17.01.33          |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 7.000.000                    |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | EUR                          |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 6.529.834                    |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 0,20                         |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | ARVAL SERVICE LEASE 4 %      |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 22.09.26                     |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 8.300.000                    |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | EUR                          |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 9.028.819                    |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 0,27                         |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | AXA 3,875 % VRN PERP         |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 7.700.000                    |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | EUR                          |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 8.261.735                    |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 0,25                         |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | AXA 6,375 % VRN PERP         |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 8.041.000                    |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | EUR                          |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 9.029.681                    |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 0,27                         |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT  |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | MUTUEL 4,125 % 9.18.2030     |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 5.900.000                    |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | EUR                          |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 6.655.667                    |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 0,20                         |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT  |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | MUTUEL 4,375 % 01.11.34      |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 8.200.000                    |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | EUR                          |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 8.806.688                    |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 0,27                         |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT  |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | MUTUEL 5,125 % 13.01.33      |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 8.000.000                    |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | EUR                          |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 9.222.503                    |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 0,28                         |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | BNP PARIBAS 2,5 % VRN        |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 31.03.32                     |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 6.000.000                    |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | EUR                          |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 6.156.343                    |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 0,19                         |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | BNP PARIBAS 3,875 % VRN      |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 10/01/2031                   |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 12.000.000                   |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | EUR                          |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 13.272.156                   |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 0,40                         |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | BNP PARIBAS 5,894 % VRN      |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 05/12/2034                   |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 1.125.000                    |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | USD                          |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 1.178.039                    |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 0,04                         |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | BPCE 5,25 % 16.04.29         |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 1.500.000                    |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | GBP                          |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 1.858.029                    |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 0,06                         |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | BPCE 6,125 % 24.05.29        |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 1.000.000                    |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | GBP                          |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 1.299.225                    |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 0,04                         |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | CARREFOUR 4,125 %            |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 12/10/2028                   |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 5.700.000                    |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | EUR                          |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 6.359.162                    |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 0,19                         |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | CREDIT AGRICOLE 2 %          |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 25.03.29                     |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 10.800.000                   |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | EUR                          |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 10.740.213                   |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 0,32                         |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | CREDIT AGRICOLE 3,875 %      |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 20.04.31                     |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 10.100.000                   |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | EUR                          |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 11.262.438                   |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 0,34                         |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | CREDIT AGRICOLE 4,875 %      |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 23.10.29                     |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 1.000.000                    |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | GBP                          |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 1.275.372                    |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 0,04                         |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | CREDIT AGRICOLE              |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | ASSURANCES 2 % 17.07.2030    |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 2.800.000                    |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | EUR                          |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 2.676.877                    |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 0,08                         |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | CREDIT MUTUEL ARKEA          |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 3,875 % 22.05.28             |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 7.500.000                    |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | EUR                          |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 8.247.375                    |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 0,25                         |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | DANONE 3,47 % 22.05.31       |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 10.000.000                   |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | EUR                          |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 10.974.194                   |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 0,33                         |                          |         |                   |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Corporate Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|--------------------|------------------------------|---|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|
| EENRED 3,625 % 13.06.2031                           | 6.200.000                | EUR     | 6.761.454          | 0,20                         | DEUTSCHE BANK 2,129 %<br>VRN 24.11.26                 | 6.640.000                | USD     | 6.267.488         | 0,19                         |
| ELECTRICITE DE FRANCE<br>4,625 % 25.01.43           | 9.000.000                | EUR     | 10.157.245         | 0,31                         | DEUTSCHE BANK 3,035 %<br>VRN 28.05.32                 | 7.620.000                | USD     | 6.435.588         | 0,19                         |
| ELECTRICITE DE FRANCE<br>4,75 % 12.10.2034          | 5.000.000                | EUR     | 5.801.037          | 0,17                         | DEUTSCHE BANK 3,75 % VRN<br>15.01.30                  | 9.900.000                | EUR     | 10.717.796        | 0,32                         |
| ELECTRICITE DE FRANCE<br>5,875 % VRN PERP           | 600.000                  | GBP     | 715.650            | 0,02                         | DEUTSCHE BANK 4 % VRN<br>24.06.26                     | 1.300.000                | GBP     | 1.605.646         | 0,05                         |
| ELECTRICITE DE FRANCE<br>6 % 23.01.14               | 200.000                  | GBP     | 240.237            | 0,01                         | DEUTSCHE BANK 6,125 %<br>VRN 12.12.30                 | 2.000.000                | GBP     | 2.564.440         | 0,08                         |
| ELECTRICITE DE FRANCE<br>6 % VRN PERP               | 400.000                  | GBP     | 493.814            | 0,01                         | DEUTSCHE BOERSE 1,25 %<br>VRN 16.06.47                | 5.900.000                | EUR     | 5.853.419         | 0,18                         |
| ENGIE 4 % 11.01.35                                  | 6.000.000                | EUR     | 6.680.917          | 0,20                         | EUROGRID 3,722 %<br>27.04.30                          | 10.000.000               | EUR     | 10.959.736        | 0,34                         |
| ENGIE 5,625 % 03.04.53                              | 1.100.000                | GBP     | 1.411.336          | 0,04                         | EUROGRID 3,915 %<br>01/02/2034                        | 2.200.000                | EUR     | 2.426.368         | 0,07                         |
| ENGIE 7 % 30.10.28                                  | 450.000                  | GBP     | 622.197            | 0,02                         | LANDESBANK BADENWUERTTEMBERG<br>1,5 % 03.02.25        | 1.000.000                | GBP     | 1.218.364         | 0,04                         |
| FRANCE (GOVT) 1,75 %<br>25.11.24                    | 24.000.000               | EUR     | 25.614.246         | 0,78                         | MERCK 1,625 % VRN<br>09/09/2080                       | 6.000.000                | EUR     | 6.108.150         | 0,18                         |
| GECINA 0,875 % 25.01.33                             | 6.900.000                | EUR     | 6.036.793          | 0,18                         | MUENCHENER RUECKVERSICHERUNG<br>3,25 % VRN 26.05.49   | 6.200.000                | EUR     | 6.488.865         | 0,20                         |
| INFRA PARK 1,625 %<br>19.04.28                      | 5.200.000                | EUR     | 5.218.939          | 0,16                         | TALANX 4 % 25.10.29                                   | 8.800.000                | EUR     | 9.791.920         | 0,29                         |
| KERING 3,375 % 27.02.33                             | 5.700.000                | EUR     | 6.141.146          | 0,18                         | VIER GAS TRANSPORT<br>2,875 % 12.06.25                | 8.800.000                | EUR     | 9.424.716         | 0,28                         |
| KERING 3,875 % 05.09.35                             | 8.000.000                | EUR     | 8.904.339          | 0,27                         | VONOVIA 4,75 % 23.05.2027                             | 4.900.000                | EUR     | 5.434.779         | 0,16                         |
| KERING 5 % 23.11.32                                 | 1.400.000                | GBP     | 1.786.466          | 0,05                         | VONOVIA 5,5 % 18.01.36                                | 300.000                  | GBP     | 374.566           | 0,01                         |
| LA BANQUE POSTALE<br>5,625 % VRN 21.09.28           | 1.400.000                | GBP     | 1.779.141          | 0,05                         |   |                          |         | <b>93.684.718</b> | <b>2,82</b>                  |
| LEGRAND 3,5 % 29.05.2029                            | 6.300.000                | EUR     | 6.924.069          | 0,21                         | <b>GROSSBRITANNIEN</b>                                |                          |         |                   |                              |
| LOREAL 3,125 % 19.05.25                             | 13.100.000               | EUR     | 14.096.675         | 0,42                         | AA BOND 7,375 % 31.07.2050                            | 240.000                  | GBP     | 313.703           | 0,01                         |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS<br>VUITTON 3,25 % 09.07.29 | 5.800.000                | EUR     | 6.340.476          | 0,19                         | ANGLIAN WATER SERVICES<br>4,5 % 22.02.26              | 1.078.000                | GBP     | 1.344.978         | 0,04                         |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS<br>MUTUEL 3,375 % 21.10.25 | 7.200.000                | EUR     | 7.783.204          | 0,23                         | ANGLIAN WATER SERVICES<br>FINANCING 5,75 % 07.06.2043 | 425.000                  | GBP     | 555.939           | 0,02                         |
| ORANGE 1,625 % 07.04.32                             | 1.900.000                | EUR     | 1.826.983          | 0,06                         | ANGLIAN WATER SERVICES<br>FINANCING PL 6 % 20.06.2039 | 1.184.000                | GBP     | 1.599.425         | 0,05                         |
| ORANGE 2,375 % VRN PERP                             | 5.700.000                | EUR     | 6.062.450          | 0,18                         | ANNINGTON FUNDING<br>3,685 % 12.07.34                 | 1.415.000                | GBP     | 1.522.173         | 0,05                         |
| ORANO 4 % 12.03.31                                  | 8.000.000                | EUR     | 8.684.068          | 0,26                         | ANNINGTON FUNDING 4,75 %<br>09/08/2033                | 553.000                  | GBP     | 656.987           | 0,02                         |
| RCI BANQUE 3,75 %<br>04/10/2027                     | 9.494.000                | EUR     | 10.262.462         | 0,31                         | AVIVA 4 % VRN 03.06.2055                              | 600.000                  | GBP     | 634.230           | 0,02                         |
| RTE RESEAU DE TRANSPORT<br>0,75 % 12.01.34          | 3.900.000                | EUR     | 3.326.580          | 0,10                         | AVIVA 5,125 % VRN<br>04/06/2050                       | 1.000.000                | GBP     | 1.217.953         | 0,04                         |
| SCHNEIDER ELECTRIC<br>3,375 % 06.04.25              | 4.700.000                | EUR     | 5.067.207          | 0,15                         | AVIVA 6,125 % 14.11.36                                | 2.150.000                | GBP     | 2.764.470         | 0,08                         |
| SOCIETE GENERALE 0,5 %<br>VRN 12.06.29              | 10.000.000               | EUR     | 9.439.848          | 0,28                         | BARCLAYS 1,7 % VRN<br>03/11/2026                      | 1.000.000                | GBP     | 1.189.928         | 0,04                         |
| SOCIETE GENERALE 5,75 %<br>VRN 22.01.32             | 1.200.000                | GBP     | 1.534.592          | 0,05                         | BARCLAYS 4,506 % VRN<br>31.01.33                      | 6.316.000                | EUR     | 7.001.242         | 0,21                         |
| SOCIETE GENERALE 6,25 %<br>22.06.33                 | 1.000.000                | GBP     | 1.368.630          | 0,04                         | BARCLAYS 5,262 % VRN<br>29.01.34                      | 8.000.000                | EUR     | 9.343.687         | 0,28                         |
| TOTALENERGIES 2 % VRN<br>PERP                       | 9.166.000                | EUR     | 9.248.894          | 0,28                         | BARCLAYS 5,69 % VRN<br>12/03/2030                     | 4.350.000                | USD     | 4.374.309         | 0,13                         |
|   |                          |         | <b>325.613.019</b> | <b>9,80</b>                  |   |                          |         |                   |                              |
| <b>DEUTSCHLAND</b>                                  |                          |         |                    |                              |   |                          |         |                   |                              |
| COMMERZBANK 1,75 %<br>22.01.25                      | 1.000.000                | GBP     | 1.225.491          | 0,04                         |   |                          |         |                   |                              |
| DEUTSCHE BAHN FINANCE<br>1,375 % 28.03.31           | 7.000.000                | EUR     | 6.787.386          | 0,20                         |   |                          |         |                   |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Corporate Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung                                      | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert   | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung                                    | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert   | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|------------|------------------------------|---|--------------------------|---------|------------|------------------------------|
| BARCLAYS 5,851 % VRN<br>21.03.35                  | 2.235.000                | GBP     | 2.863.366  | 0,09                         | HAMMERSON 7,25 %<br>21.04.28                    | 1.100.000                | GBP     | 1.446.084  | 0,04                         |
| BARCLAYS 6,369 % VRN<br>31.01.31                  | 1.500.000                | GBP     | 1.977.744  | 0,06                         | HEATHROW FINANCE 5,75 %<br>03/03/2025           | 550.000                  | GBP     | 693.225    | 0,02                         |
| BARCLAYS 6,692 % VRN<br>13.09.34                  | 5.040.000                | USD     | 5.380.874  | 0,16                         | HEATHROW FINANCE 6,625 %<br>01/03/2031          | 818.000                  | GBP     | 1.024.026  | 0,03                         |
| BARCLAYS 7,325 % VRN<br>02/11/2026                | 12.205.000               | USD     | 12.507.817 | 0,38                         | HEATHROW FUNDING 4,625 %<br>31.10.46            | 660.000                  | GBP     | 735.359    | 0,02                         |
| BARCLAYS 8,407 % VRN<br>14.11.32                  | 508.000                  | GBP     | 683.560    | 0,02                         | HEATHROW FUNDING 5,875 %<br>13.05.41            | 500.000                  | GBP     | 657.708    | 0,02                         |
| BARCLAYS PLC 6,224 % VRN<br>09/05/2034            | 4.800.000                | USD     | 4.959.417  | 0,15                         | HEATHROW FUNDING 6 %<br>05/03/2032              | 1.047.000                | GBP     | 1.340.462  | 0,04                         |
| BP CAPITAL MARKETS<br>3,625 % VRN PERP            | 10.000.000               | EUR     | 10.325.487 | 0,31                         | HISCOX 6,125 % VRN<br>24.11.45                  | 1.300.000                | GBP     | 1.636.737  | 0,05                         |
| BP CAPITAL MARKETS<br>4,25 % VRN PERP             | 2.000.000                | GBP     | 2.397.025  | 0,07                         | HSBC HOLDINGS 1,75 % VRN<br>24.07.27            | 1.500.000                | GBP     | 1.750.048  | 0,05                         |
| BP CAPITAL MARKETS<br>4,375 % VRN PERP            | 1.173.000                | USD     | 1.152.831  | 0,03                         | HSBC HOLDINGS 3 % VRN<br>22.07.28               | 1.000.000                | GBP     | 1.178.851  | 0,04                         |
| BP CAPITAL MARKETS PLC<br>5,773 % 25.05.38        | 1.414.000                | GBP     | 1.915.337  | 0,06                         | HSBC HOLDINGS 4,599 %<br>VRN 22.03.35           | 10.219.000               | EUR     | 11.141.782 | 0,34                         |
| BRITISH TELECOMMUNICATIONS<br>3,125 % 21.11.31    | 1.000.000                | GBP     | 1.118.165  | 0,03                         | HSBC HOLDINGS 5,875 %<br>VRN PERP               | 1.295.000                | GBP     | 1.573.099  | 0,05                         |
| BRITISH TELECOMMUNICATIONS<br>5,75 % 13.02.41     | 827.000                  | GBP     | 1.055.538  | 0,03                         | HSBC HOLDINGS 6,8 % VRN<br>14.09.31             | 1.286.000                | GBP     | 1.753.079  | 0,05                         |
| BROADGATE 4,821 %<br>05/07/2036                   | 540.000                  | GBP     | 678.512    | 0,02                         | HSBC HOLDINGS 7 %<br>07/04/2038                 | 800.000                  | GBP     | 1.117.051  | 0,03                         |
| BUPA FINANCE 2 %<br>05/04/2024                    | 975.000                  | GBP     | 1.231.397  | 0,04                         | HSBC HOLDINGS 8,201 %<br>VRN 16.11.34           | 1.972.000                | GBP     | 2.746.851  | 0,08                         |
| BUPA FINANCE 5 %<br>08/12/2026                    | 425.000                  | GBP     | 531.229    | 0,02                         | INTERNATIONAL DISTRIBUTIONS<br>7,375 % 14.09.30 | 1.300.000                | GBP     | 1.735.157  | 0,05                         |
| CADENT FINANCE 5,625 %<br>11/01/2036              | 883.000                  | GBP     | 1.135.546  | 0,03                         | LEGAL GENERAL GROUP<br>4,5 % VRN 01.11.50       | 1.900.000                | GBP     | 2.237.163  | 0,07                         |
| CENTRICA 7 % 19.09.2033                           | 1.390.000                | GBP     | 1.982.309  | 0,06                         | LEGAL AND GENERAL GROUP<br>5,375 % VRN 27.10.45 | 1.405.000                | GBP     | 1.765.696  | 0,05                         |
| CENTRICA PLC 4,25 %<br>12/09/2044                 | 1.000.000                | GBP     | 1.064.991  | 0,03                         | LLOYDS BANKING GROUP<br>1,875 % VRN 15.01.26    | 1.870.000                | GBP     | 2.295.627  | 0,07                         |
| CLARION FUNDING 1,875 %<br>22.01.35               | 3.162.000                | GBP     | 2.949.264  | 0,09                         | LLOYDS BANKING GROUP<br>2,707 % VRN 03.12.35    | 1.503.000                | GBP     | 1.546.281  | 0,05                         |
| CLARION HOUSING GROUP<br>3,125 % 19.04.48         | 1.000.000                | GBP     | 902.024    | 0,03                         | LLOYDS BANKING GROUP<br>6,625 % VRN 02.06.33    | 1.091.000                | GBP     | 1.402.987  | 0,04                         |
| COVENTRY BUILDING SOCIETY<br>5,875 % VRN 03.12.30 | 1.500.000                | GBP     | 1.918.190  | 0,06                         | LONDON POWER NETWORKS<br>5,875 % 15.11.40       | 472.000                  | GBP     | 639.144    | 0,02                         |
| CYBG 4 % VRN 25.09.2026                           | 1.000.000                | GBP     | 1.234.457  | 0,04                         | LONDON QUADRANT HOUSING<br>TRUST 2 % 31.03.32   | 900.000                  | GBP     | 914.061    | 0,03                         |
| DIAGEO FINANCE 2,75 %<br>08/06/2038               | 1.000.000                | GBP     | 1.001.400  | 0,03                         | LONDON QUADRANT HOUSING<br>TRUST 2 % 20.10.38   | 1.050.000                | GBP     | 899.351    | 0,03                         |
| EASTERN POWER NETWORKS<br>5,375 % 26.02.42        | 471.000                  | GBP     | 603.396    | 0,02                         | MOTABILITY OPERATIONS<br>GROUP 2,375 % 03.07.39 | 380.000                  | GBP     | 346.145    | 0,01                         |
| GATWICK FUNDING 3,125 %<br>28.09.41               | 1.614.000                | GBP     | 1.551.777  | 0,05                         | MOTABILITY OPERATIONS<br>GROUP 4,875 % 17.01.43 | 1.757.000                | GBP     | 2.158.655  | 0,06                         |
| GATWICK FUNDING 5,5 %<br>04/04/2040               | 670.000                  | GBP     | 838.668    | 0,03                         | MOTABILITY OPERATIONS<br>GROUP 5,625 % 24.01.54 | 473.000                  | GBP     | 637.737    | 0,02                         |
| GLAXOSMITHKLINE 6,375 %<br>09/03/2039             | 900.000                  | GBP     | 1.305.383  | 0,04                         |   |                          |         |            |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Corporate Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert   | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert   | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--------------------------|---------|------------|------------------------------|---|--------------------------|---------|------------|------------------------------|
| NATIONAL GRID 3,875 %<br>16.01.29                          | 12.525.000               | EUR     | 13.773.473 | 0,40                         | PLACES FOR PEOPLE HOMES<br>5,875 % 23.05.31                   | 500.000                  | GBP     | 654.683    | 0,02                         |
| NATIONAL GRID ELECTRICITY<br>5,35 % 07.10.39               | 1.362.000                | GBP     | 1.724.893  | 0,05                         | PLACES FOR PEOPLE<br>TREASURY 2,5 % 26.01.36                  | 1.262.000                | GBP     | 1.200.088  | 0,04                         |
| NATIONAL GRID ELECTRICITY TRANS-<br>MISSION 4 % 08.06.2027 | 450.000                  | GBP     | 552.206    | 0,02                         | PLACES FOR PEOPLE TREASURY<br>6,25 % 06.12.41                 | 1.056.000                | GBP     | 1.439.558  | 0,04                         |
| NATIONAL GRID GAS<br>1,375 % 07.02.31                      | 1.241.000                | GBP     | 1.228.706  | 0,04                         | PRINCIPALITY BUILDING<br>SOCIETY 8,625 % 12.07.2028           | 1.264.000                | GBP     | 1.744.292  | 0,05                         |
| NATIONAL GRID GAS<br>1,625 % 14.01.43                      | 1.188.000                | GBP     | 827.563    | 0,02                         | PRUDENTIAL 3,875 % VRN<br>20.07.49                            | 700.000                  | GBP     | 878.540    | 0,03                         |
| NATIONAL GRID GAS<br>FINANCE 2,625 % 22.09.38              | 1.000.000                | GBP     | 902.798    | 0,03                         | PRUDENTIAL 5 % VRN<br>20.07.55                                | 500.000                  | GBP     | 586.249    | 0,02                         |
| NATIONAL GRID GAS<br>FINANCE 2,75 % 22.09.46               | 713.000                  | GBP     | 572.535    | 0,02                         | PRUDENTIAL 5,7 % VRN<br>19.12.63                              | 607.000                  | GBP     | 752.784    | 0,02                         |
| NATIONWIDE BUILDING SOCIETY<br>2 % VRN 25.07.29            | 8.000.000                | EUR     | 8.567.878  | 0,26                         | PRUDENTIAL FUNDING ASIA<br>3,625 % 24.03.32                   | 9.865.000                | USD     | 8.916.255  | 0,27                         |
| NATIONWIDE BUILDING SOCIETY<br>6,557 % VRN 10.18.2027      | 5.370.000                | USD     | 5.513.350  | 0,17                         | RAC BOND 8,25 % 06.05.2046                                    | 195.000                  | GBP     | 270.248    | 0,01                         |
| NATWEST GROUP 1,642 %<br>VRN 14.06.27                      | 6.380.000                | USD     | 5.870.237  | 0,18                         | ROYAL BANK OF SCOTLAND<br>3,125 % VRN 28.03.27                | 2.300.000                | GBP     | 2.783.574  | 0,08                         |
| NATWEST GROUP 3,619 %<br>VRN 29.03.29                      | 1.739.000                | GBP     | 2.066.147  | 0,06                         | ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP<br>3,622 % VRN 14.09.30          | 991.000                  | GBP     | 1.215.334  | 0,04                         |
| NATWEST GROUP 6,475 %<br>VRN 01.06.34                      | 6.885.000                | USD     | 7.004.838  | 0,21                         | ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP<br>3,754 % VRN 11.01.29          | 800.000                  | USD     | 787.582    | 0,02                         |
| NATWEST GROUP 7,416 %<br>VRN 06.06.33                      | 768.000                  | GBP     | 1.015.816  | 0,03                         | SANTANDER UK GROUP HOLDINGS<br>2,92 % VRN 05.08.26            | 1.000.000                | GBP     | 1.223.178  | 0,04                         |
| NATWEST GROUP PLC 1,75 %<br>VRN 02.03.26                   | 10.000.000               | EUR     | 10.593.690 | 0,32                         | SANTANDER UK GROUP HOLDINGS<br>7,098 % VRN 16.11.27           | 729.000                  | GBP     | 951.823    | 0,03                         |
| NATWEST MARKETS 1,6 %<br>29.09.26                          | 5.175.000                | USD     | 4.736.656  | 0,14                         | SANTANDER UK GROUP HOLDINGS<br>7,482 % VRN 29.08.29           | 1.050.000                | GBP     | 1.417.701  | 0,04                         |
| NGG FINANCE 5,625 % VRN<br>18.06.73                        | 1.100.000                | GBP     | 1.377.238  | 0,04                         | SCOTTISH & SOUTHERN<br>8,375 % 20.11.28                       | 1.700.000                | GBP     | 2.472.252  | 0,07                         |
| NORTHERN POWERGRID NORTHEAST<br>1,875 % 16.06.62           | 1.000.000                | GBP     | 623.108    | 0,02                         | SCOTTISH & SOUTHERN<br>ENERGY 2,25 % 27.09.35                 | 650.000                  | GBP     | 630.891    | 0,02                         |
| NORTHERN POWERGRID NORTHEAST<br>3,25 % 01.04.2052          | 1.446.000                | GBP     | 1.312.808  | 0,04                         | SCOTTISH HYDRO ELECTRIC<br>TRANSMISS 5,5 % 15.01.2044         | 1.030.000                | GBP     | 1.323.194  | 0,04                         |
| NORTHUMBRIAN WATER<br>FINANCE 2,375 % 05.10.27             | 1.329.000                | GBP     | 1.526.019  | 0,05                         | SEVERN TRENT UTILITIES<br>FINANCE 4,625 % 30.11.34            | 719.000                  | GBP     | 870.242    | 0,03                         |
| NORTHUMBRIAN WATER<br>FINANCE 4,5 % 14.02.31               | 617.000                  | GBP     | 745.471    | 0,02                         | SOUTH EASTERN POWER NETWORKS<br>6,375 % 12.11.31              | 800.000                  | GBP     | 1.113.384  | 0,03                         |
| NORTHUMBRIAN WATER FINANCE<br>MUTUEL 6,375 % 28.10.34      | 1.167.000                | GBP     | 1.576.440  | 0,05                         | SOUTHERN GAS NETWORK<br>3,1 % 15.09.36                        | 1.000.000                | GBP     | 1.003.421  | 0,03                         |
| PEABODY CAPITAL<br>5,25 % 17.03.43                         | 1.600.000                | GBP     | 2.028.404  | 0,06                         | SOUTHERN WATER SERVICES<br>FINANCE 2,375 % 28.05.28           | 850.000                  | GBP     | 942.688    | 0,03                         |
| PENSION INSURANCE<br>4,625 % 07.05.31                      | 250.000                  | GBP     | 284.725    | 0,01                         | SOUTHERN WATER SERVICES<br>FINANCE 3 % 28.05.37               | 750.000                  | GBP     | 685.231    | 0,02                         |
| PENSION INSURANCE 6,5 %<br>03/07/2024                      | 2.483.000                | GBP     | 3.139.988  | 0,09                         | SP MANWEB 4,875 %<br>20.09.27                                 | 500.000                  | GBP     | 633.452    | 0,02                         |
| PENSION INSURANCE 8 %<br>13.11.33                          | 900.000                  | GBP     | 1.243.924  | 0,04                         | SSE 3,74 % VRN PERP<br>STANDARD CHARTERED<br>1,822 % 23.11.25 | 2.150.000                | GBP     | 2.593.126  | 0,08                         |
| PHOENIX GROUP HOLDINGS<br>7,75 % VRN 06.12.53              | 922.000                  | GBP     | 1.246.627  | 0,04                         | STANDARD CHARTERED<br>4,196 % VRN 04.03.32                    | 10.935.000               | USD     | 10.639.629 | 0,32                         |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Corporate Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert   | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung                                       | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|------------|------------------------------|--|--------------------------|---------|--------------------|------------------------------|
| STANDARD CHARTERED<br>7,018 % 08.02.30                  | 7.480.000                | USD     | 7.932.827  | 0,24                         | YORKSHIRE WATER FINANCE<br>1,75 % 26.11.26         | 1.333.000                | GBP     | 1.531.285          | 0,05                         |
| STANDARD CHARTERED FRN<br>30.03.26                      | 21.565.000               | USD     | 21.776.931 | 0,65                         |  |                          |         | <b>372.533.730</b> | <b>11,23</b>                 |
| SW FINANCE 7 % 16.04.2040                               | 1.718.000                | GBP     | 2.178.845  | 0,07                         | <b>IRLAND</b>                                      |                          |         |                    |                              |
| SW FINANCE 7,375 %<br>12/12/2041                        | 728.000                  | GBP     | 969.562    | 0,03                         | AERCAP IRELAND CAPITAL<br>4,45 % 01.10.25          | 3.570.000                | USD     | 3.517.153          | 0,11                         |
| TELEREAL SECURITISATION<br>5,634 % 10.12.31             | 2.332.000                | GBP     | 2.970.141  | 0,09                         | AERCAP IRELAND CAPITAL<br>4,625 % 15.10.27         | 6.580.000                | USD     | 6.423.027          | 0,19                         |
| TELEREAL SECURITISATION<br>6,1645 % 10.12.33            | 622.000                  | GBP     | 639.311    | 0,02                         | AIB GROUP 5,25 % VRN<br>23.10.31                   | 5.333.000                | EUR     | 6.225.245          | 0,19                         |
| TESCO CORPORATE TREASURY<br>SERVICES 1,875 % 11.02.2028 | 545.000                  | GBP     | 614.609    | 0,02                         | APTIV 4,15 % 01.05.52                              | 7.000.000                | USD     | 5.374.104          | 0,16                         |
| THAMES WATER 5,125 %<br>28.09.37                        | 2.013.000                | GBP     | 2.123.888  | 0,06                         | BANK OF IRELAND 1,375 %<br>VRN 11.08.31            | 4.764.000                | EUR     | 4.816.683          | 0,15                         |
| THAMES WATER 6,75 %<br>16.11.28                         | 520.000                  | GBP     | 643.515    | 0,02                         | ESB FINANCE 4 % 03.05.2032                         | 10.000.000               | EUR     | 11.210.342         | 0,33                         |
| THAMES WATER UTIL CAY<br>FI 4,625 % 04.06.46            | 111.000                  | GBP     | 105.256    | 0,00                         | GE CAPITAL 5,875 %<br>18.01.33                     | 1.000.000                | GBP     | 1.332.254          | 0,04                         |
| THAMES WATER UTILITIES<br>7,738 % 09.04.58              | 413.000                  | GBP     | 530.268    | 0,02                         | JOHNSON CONTROLS<br>INTERNATIONAL 0,375 % 15.09.27 | 9.200.000                | EUR     | 8.979.121          | 0,27                         |
| THAMES WATER UTILITIES<br>FINANCE 7,75 % 30.04.44       | 700.000                  | GBP     | 889.403    | 0,03                         |  |                          |         | <b>47.877.929</b>  | <b>1,44</b>                  |
| THAMES WATER UTILITIES<br>FINANCE 8,25 % 25.04.40       | 100.000                  | GBP     | 134.968    | 0,00                         | <b>ITALIEN</b>                                     |                          |         |                    |                              |
| UK (GOVT) 1,25 %<br>22.10.41                            | 10.677.000               | GBP     | 8.461.970  | 0,25                         | 2I RETE GAS 1,608 %<br>31.10.27                    | 7.400.000                | EUR     | 7.522.049          | 0,23                         |
| UK (GOVT) 1,25 %<br>31.07.51                            | 4.050.000                | GBP     | 2.586.561  | 0,08                         | ASSICURAZIONI GENERALI<br>5,272 % 12.09.33         | 7.687.000                | EUR     | 8.837.295          | 0,27                         |
| UK (GOVT) 4,625 %<br>31.01.34                           | 8.500.000                | GBP     | 11.347.692 | 0,34                         | ASSICURAZIONI GENERALI<br>5,399 % 20.04.33         | 5.500.000                | EUR     | 6.386.836          | 0,19                         |
| VIRGIN MONEY 11 % VRN<br>PERP                           | 330.000                  | GBP     | 469.508    | 0,01                         | ENEL 4,75 % VRN PERP<br>SNAM 4 % 27.11.29          | 10.000.000               | EUR     | 10.738.535         | 0,32                         |
| VIRGIN MONEY 5,125 % VRN<br>11/12/2030                  | 280.000                  | GBP     | 348.055    | 0,01                         | UNICREDIT 1,8 % 20.01.30                           | 3.478.000                | EUR     | 3.854.712          | 0,12                         |
| VIRGIN MONEY UK 2,625 %<br>VRN 19.08.31                 | 462.000                  | GBP     | 541.187    | 0,02                         | UNICREDIT 4 % 05.03.2034                           | 2.550.000                | EUR     | 2.465.819          | 0,07                         |
| VODAFONE GROUP 2,2 %<br>25.08.26                        | 9.600.000                | EUR     | 10.114.170 | 0,30                         | UNICREDIT 4,3 % VRN<br>23.01.31                    | 13.583.000               | EUR     | 14.884.361         | 0,44                         |
| VODAFONE GROUP 3 %<br>12/08/2056                        | 1.699.000                | GBP     | 1.338.657  | 0,04                         |  |                          |         | 9.882.100          | 0,30                         |
| WEIR GROUP PLCTHE<br>6,875 % 14.06.28                   | 1.070.000                | GBP     | 1.418.743  | 0,04                         | <b>JAPAN</b>                                       |                          |         | <b>64.571.707</b>  | <b>1,94</b>                  |
| WESSEX WATER SERVICES<br>FINANCE 1,50 % 17.09.29        | 900.000                  | GBP     | 941.265    | 0,03                         | TAKEDA PHARMACEUTICAL<br>3 % 21.11.30              | 12.100.000               | EUR     | 12.782.921         | 0,38                         |
| WESTERN POWER 5,75 %<br>23.03.40                        | 650.000                  | GBP     | 854.251    | 0,03                         |  |                          |         | <b>12.782.921</b>  | <b>0,38</b>                  |
| WESTERN POWER DISTRIBUTION<br>1,625 % 07.10.35          | 1.100.000                | GBP     | 969.387    | 0,03                         | <b>JERSEY</b>                                      |                          |         |                    |                              |
| WPP FINANCE 4 % 12.09.2033                              | 10.511.000               | EUR     | 11.405.963 | 0,34                         | AA BOND 5,5 % 31.07.2050                           | 700.000                  | GBP     | 862.537            | 0,03                         |
| YORKSHIRE POWER 7,25 %<br>04/08/2028                    | 489.000                  | GBP     | 665.282    | 0,02                         | CPUK FINANCE 5,876 %<br>28.08.27                   | 1.000.000                | GBP     | 1.277.422          | 0,04                         |
|   |                          |         |            |                              | CPUK FINANCE 6,136 %<br>28.02.47                   | 500.000                  | GBP     | 651.084            | 0,02                         |
|   |                          |         |            |                              | HEATHROW FUNDING 6,75 %<br>03/12/2028              | 990.000                  | GBP     | 1.299.902          | 0,03                         |
|   |                          |         |            |                              | HSBC BANK FUND 5,844 %<br>VRN PERP                 | 700.000                  | GBP     | 929.831            | 0,03                         |
|   |                          |         |            |                              |  |                          |         | <b>5.020.776</b>   | <b>0,15</b>                  |
|   |                          |         |            |                              | <b>LUXEMBURG</b>                                   |                          |         |                    |                              |
|   |                          |         |            |                              | AROUNDTOWN 3,625 %<br>10/04/2031                   | 750.000                  | GBP     | 716.373            | 0,02                         |
|   |                          |         |            |                              | AROUNDTOWN 4,75 % VRN<br>PERP                      | 1.895.000                | GBP     | 1.447.391          | 0,04                         |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Corporate Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|---|--------------------------|---------|--------------------|------------------------------|
| BLACKSTONE PROPERTY PARTNERS<br>4,875 % 29.04.32     | 200.000                  | GBP     | 227.645           | 0,01                         | INNOGY FINANCE 6,125 %<br>06/07/2039                  | 500.000                  | GBP     | 675.465            | 0,02                         |
| CK HUTCHISON GROUP TELECOM<br>FINANCE 2 % 10.17.2027 | 1.300.000                | GBP     | 1.472.508         | 0,04                         | JDE PEETS 4,5 % 23.01.2034                            | 4.511.000                | EUR     | 5.073.630          | 0,15                         |
| CNH INDUSTRIAL FINANCE<br>EUROPE 1,625 % 03.07.29    | 9.200.000                | EUR     | 9.075.244         | 0,27                         | KONINKLIJKE 0,625 %<br>09/04/2025                     | 10.000.000               | EUR     | 10.474.480         | 0,32                         |
| EUROCLEAR INVESTMENTS<br>2,625 % VRN 11.04.48        | 6.500.000                | EUR     | 6.584.889         | 0,20                         | KONINKLIJKE AHOLD<br>DELHAIZE 1,75 % 02.04.2027       | 6.600.000                | EUR     | 6.837.715          | 0,21                         |
| JOHN DEERE BANK 5,125 %<br>18.10.28                  | 1.200.000                | GBP     | 1.556.056         | 0,05                         | LEASEPLAN 0,25 %<br>23.02.26                          | 6.000.000                | EUR     | 6.070.561          | 0,18                         |
| LOGICOR FINANCING 2,75 %<br>15.01.30                 | 578.000                  | GBP     | 618.078           | 0,02                         | LEASEPLAN 0,25 %<br>07/09/2026                        | 6.000.000                | EUR     | 5.978.326          | 0,18                         |
| NESTLE FINANCE INTERNATIONAL<br>0 % 03.03.33         | 3.300.000                | EUR     | 2.763.877         | 0,08                         | MERCEDESSENZ INTERNATIONAL<br>FINANCE 3,25 % 01.10.32 | 4.511.000                | EUR     | 4.863.378          | 0,15                         |
| NESTLE FINANCE INTERNATIONAL<br>3,75 % 14.11.35      | 7.100.000                | EUR     | 8.066.665         | 0,24                         | NN GROUP 4,5 % VRN PERP<br>NN GROUP 6 % VRN           | 8.000.000                | EUR     | 8.667.355          | 0,26                         |
| RICHEMONT INTERNATIONAL<br>HOLDING 1,125 % 26.05.32  | 8.968.000                | EUR     | 8.361.487         | 0,26                         | 03/11/2043  | 7.969.000                | EUR     | 9.408.695          | 0,28                         |
|  |                          |         | <b>40.890.213</b> | <b>1,23</b>                  | NN GROUP 6,375 % VRN PERP                             | 5.581.000                | EUR     | 6.063.706          | 0,18                         |
| <b>NIEDERLANDE</b>                                   |                          |         |                   |                              | PLUXEE 3,5 % 04.09.28                                 | 6.200.000                | EUR     | 6.703.798          | 0,20                         |
| AERCAP HOLDINGS 5,875 %<br>VRN 10.10.79              | 2.100.000                | USD     | 2.088.827         | 0,06                         | RELX FINANCE 3,375 %<br>20.03.33                      | 10.521.000               | EUR     | 11.399.915         | 0,35                         |
| ASR NEDERLAND 3,625 %<br>12/12/2028                  | 1.652.000                | EUR     | 1.789.010         | 0,05                         | SHELL INTERNATIONAL<br>FINANCE 1,75 % 10.09.52        | 750.000                  | GBP     | 483.271            | 0,01                         |
| COOPERATIEVE RABOBANK<br>1,106 % VRN 24.02.27        | 4.830.000                | USD     | 4.451.058         | 0,13                         | SIEMENS FINANCIERINGSMAATSCHAPP<br>0,375 % 06.05.26   | 8.200.000                | EUR     | 8.332.584          | 0,25                         |
| COOPERATIEVE RABOBANK<br>3,1 % VRN PERP              | 5.000.000                | EUR     | 4.695.568         | 0,14                         | THERMO FISHER SCIENTIFIC<br>FINANCE 1,625 % 18.10.41  | 6.000.000                | EUR     | 4.889.928          | 0,15                         |
| DIAGEO CAPITAL 1,5 %<br>08/06/2029                   | 7.000.000                | EUR     | 7.000.364         | 0,21                         | UNIVERSAL MUSIC GROUP<br>4 % 13.06.31                 | 6.184.000                | EUR     | 6.914.411          | 0,21                         |
| E.ON 5,875 % 30.10.2037                              | 1.500.000                | GBP     | 1.986.830         | 0,06                         | VESTEDA FINANCE 1,5 %<br>24.05.27                     | 7.500.000                | EUR     | 7.584.394          | 0,23                         |
| EDP FINANCE 1,875 %<br>21.09.29                      | 6.100.000                | EUR     | 6.084.419         | 0,18                         |   |                          |         | <b>198.236.200</b> | <b>5,97</b>                  |
| ENEL FINANCE 5,75 %<br>14.09.40                      | 1.224.000                | GBP     | 1.596.580         | 0,05                         | <b>NORWEGEN</b>                                       |                          |         |                    |                              |
| ENEL FINANCE INTERNATIONAL<br>2,875 % 04.11.29       | 3.042.000                | GBP     | 3.502.485         | 0,11                         | DNB BANK 0,25 % VRN<br>23.02.29                       | 8.800.000                | EUR     | 8.363.919          | 0,25                         |
| ENEL FINANCE INTERNATIONAL<br>3,875 % 23.01.35       | 10.000.000               | EUR     | 10.897.502        | 0,34                         | DNB BANK 4 % VRN<br>17.08.27                          | 2.199.000                | GBP     | 2.711.175          | 0,08                         |
| GIVAUDAN FINANCE EUROPE<br>1,625 % 22.04.32          | 7.400.000                | EUR     | 7.079.087         | 0,21                         | DNB BANK 4,625 % VRN<br>28.02.33                      | 9.200.000                | EUR     | 10.094.715         | 0,31                         |
| HM FINANCE 4,875 %<br>25.10.31                       | 3.609.000                | EUR     | 4.141.057         | 0,12                         | STATOIL ASA 1,25 %<br>17.02.27                        | 4.000.000                | EUR     | 4.088.733          | 0,12                         |
| ING GROEP 5,55 % VRN<br>19.03.35                     | 20.500.000               | USD     | 20.374.266        | 0,62                         |   |                          |         | <b>25.258.542</b>  | <b>0,76</b>                  |
| ING GROEP 6,25 % VRN<br>20.05.33                     | 600.000                  | GBP     | 765.705           | 0,02                         | <b>PORTUGAL</b>                                       |                          |         |                    |                              |
| ING GROEP FRN 1 %<br>13.11.30                        | 7.500.000                | EUR     | 7.690.995         | 0,23                         | CAIXA GERAL DE DEPOSITOS<br>5,75 % VRN 31.10.28       | 4.800.000                | EUR     | 5.544.355          | 0,17                         |
| INNOGY FINANCE 4,75 %<br>31.01.34                    | 3.000.000                | GBP     | 3.670.835         | 0,11                         | EDP ENERGIAS DE PORTUGAL<br>1,625 % 15.04.27          | 5.300.000                | EUR     | 5.443.465          | 0,16                         |
|  |                          |         |                   |                              |   |                          |         | <b>10.987.820</b>  | <b>0,33</b>                  |
|  |                          |         |                   |                              | <b>SINGAPUR</b>                                       |                          |         |                    |                              |
|  |                          |         |                   |                              | PFIZER INVESTMENT<br>ENTERPRISES 4,75 %<br>19/05/2033 | 4.330.000                | USD     | 4.269.519          | 0,13                         |
|  |                          |         |                   |                              |   |                          |         | <b>4.269.519</b>   | <b>0,13</b>                  |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Corporate Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung                    | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung                        | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---------------------------------|--------------------------|---------|--------------------|------------------------------|-------------------------------------|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|
| <b>SPANIEN</b>                  |                          |         |                    |                              | NORDEA BANK 0,625 % VRN             |                          |         |                   |                              |
| ABERTIS INFRAESTRUCTURAS        |                          |         |                    |                              | 18.08.31                            | 8.800.000                | EUR     | 8.803.176         | 0,27                         |
| 3,375 % 27.11.26                | 1.000.000                | GBP     | 1.202.009          | 0,04                         | SKANDINAVISKA ENSKILDA              |                          |         |                   |                              |
| AENA SME 4,25 % 13.10.2030      | 6.000.000                | EUR     | 6.804.285          | 0,20                         | BANKEN 1,75 % 11.11.26              | 10.000.000               | EUR     | 10.372.887        | 0,31                         |
| BANCO BILBAO VIZCAYA            |                          |         |                    |                              | TELE 3,75 % 22.11.29                | 5.530.000                | EUR     | 6.033.756         | 0,18                         |
| 4,875 % VRN 08.02.36            | 3.200.000                | EUR     | 3.487.599          | 0,11                         | VOLVO TREASURY 2,625 %              |                          |         |                   |                              |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENT     |                          |         |                    |                              | 20.02.26                            | 5.794.000                | EUR     | 6.151.589         | 0,19                         |
| 0,875 % VRN 14.01.29            | 10.600.000               | EUR     | 10.374.704         | 0,31                         | VOLVO TREASURY 3,75 %               |                          |         |                   |                              |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA |                          |         |                    |                              | 25.11.24                            | 8.585.000                | EUR     | 9.263.060         | 0,28                         |
| 3,375 % 20.09.27                | 7.700.000                | EUR     | 8.320.856          | 0,25                         |                                     |                          |         | <b>59.397.827</b> | <b>1,79</b>                  |
| BANCO SANTANDER 4,175 %         |                          |         |                    |                              | <b>SCHWEIZ</b>                      |                          |         |                   |                              |
| VRN 24.03.28                    | 5.000.000                | USD     | 4.822.984          | 0,15                         | CREDIT SUISSE 3,625 %               |                          |         |                   |                              |
| BANCO SANTANDER 4,25 %          |                          |         |                    |                              | 09/09/2024                          | 2.268.000                | USD     | 2.247.354         | 0,07                         |
| 11/04/2027                      | 1.600.000                | USD     | 1.552.652          | 0,05                         | CREDIT SUISSE GROUP                 |                          |         |                   |                              |
| BANCO SANTANDER 5,375 %         |                          |         |                    |                              | 2,25 % VRN 09.06.28                 | 4.950.000                | GBP     | 5.715.794         | 0,17                         |
| 17.01.31                        | 1.400.000                | GBP     | 1.789.016          | 0,05                         | UBS GROUP 2,746 %                   |                          |         |                   |                              |
| BANCO SANTANDER 5,538 %         |                          |         |                    |                              | 11/02/2033                          | 7.590.000                | USD     | 6.220.239         | 0,19                         |
| VRN 14.03.30                    | 8.600.000                | USD     | 8.604.012          | 0,26                         | UBS GROUP 4,625 % VRN               |                          |         |                   |                              |
| BANCO SANTANDER 5,75 %          |                          |         |                    |                              | 17.03.28                            | 10.000.000               | EUR     | 11.077.943        | 0,33                         |
| VRN 23.08.33                    | 9.200.000                | EUR     | 10.450.148         | 0,31                         | UBS GROUP 5,699 % VRN               |                          |         |                   |                              |
| BANCO SANTANDER 6,607 %         |                          |         |                    |                              | 08/02/2035                          | 4.735.000                | USD     | 4.768.824         | 0,14                         |
| 07/11/2028                      | 4.600.000                | USD     | 4.869.462          | 0,15                         |                                     |                          |         | <b>30.030.154</b> | <b>0,90</b>                  |
| BANCO SANTANDER 6,921 %         |                          |         |                    |                              | <b>VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE</b> |                          |         |                   |                              |
| 08/08/2033                      | 3.600.000                | USD     | 3.771.892          | 0,11                         | FIRST ABU DHABI BANK                |                          |         |                   |                              |
| BANKINTER 1,25 % VRN            |                          |         |                    |                              | 1,125 % 07.09.26                    | 900.000                  | GBP     | 1.038.698         | 0,03                         |
| 23.12.32                        | 7.400.000                | EUR     | 7.234.456          | 0,22                         |                                     |                          |         | <b>1.038.698</b>  | <b>0,03</b>                  |
| BANKINTER 4,375 % VRN           |                          |         |                    |                              | <b>USA</b>                          |                          |         |                   |                              |
| 03/05/2030                      | 6.000.000                | EUR     | 6.715.241          | 0,20                         | ALEXANDRIA REAL ESTATE              |                          |         |                   |                              |
| CAIXABANK 1,5 % VRN             |                          |         |                    |                              | EQUITIES 5,15 % 15.04.2053          | 1.985.000                | USD     | 1.830.045         | 0,06                         |
| 03/12/2026                      | 1.100.000                | GBP     | 1.304.559          | 0,04                         | AMERICAN HONDA FINANCE              |                          |         |                   |                              |
| CAIXABANK 3,50 % VRN            |                          |         |                    |                              | 5,6 % 06.09.30                      | 1.421.000                | GBP     | 1.888.945         | 0,06                         |
| 06/04/2028                      | 2.000.000                | GBP     | 2.400.507          | 0,07                         | AMERICAN TOWER 2,3 %                |                          |         |                   |                              |
| CAIXABANK 5 % VRN               |                          |         |                    |                              | 15.09.31                            | 3.500.000                | USD     | 2.860.127         | 0,09                         |
| 19.07.29                        | 7.700.000                | EUR     | 8.712.039          | 0,26                         | AMERICAN TOWER 5,25 %               |                          |         |                   |                              |
| CELLNEX FINANCE 1,5 %           |                          |         |                    |                              | 15.07.28                            | 4.000.000                | USD     | 4.006.235         | 0,12                         |
| 08/06/2028                      | 8.000.000                | EUR     | 7.948.052          | 0,24                         | ANHEUSERBUSCH 4,7 %                 |                          |         |                   |                              |
| IBERDROLA FINANZAS              |                          |         |                    |                              | 01/02/2036                          | 9.665.000                | USD     | 9.407.294         | 0,28                         |
| 3,625 % 13.07.33                | 9.600.000                | EUR     | 10.542.081         | 0,32                         | ANHEUSERBUSCH 4,9 %                 |                          |         |                   |                              |
| IBERDROLA FINANZAS              |                          |         |                    |                              | 01/02/2046                          | 4.835.000                | USD     | 4.609.486         | 0,14                         |
| 4,871 % VRN PERP                | 4.100.000                | EUR     | 4.475.349          | 0,13                         | ANHEUSERBUSCH INBEV                 |                          |         |                   |                              |
| IBERDROLA FINANZAS              |                          |         |                    |                              | WORLDWIDE 5 % 15.06.2034            | 10.955.000               | USD     | 11.017.524        | 0,33                         |
| 4,875 % VRN PERP                | 6.700.000                | EUR     | 7.353.497          | 0,22                         | ASHTREAD CAPITAL 5,95 %             |                          |         |                   |                              |
| MAPFRE 2,875 % 13.04.30         | 10.300.000               | EUR     | 10.393.222         | 0,31                         | 15.10.33                            | 4.080.000                | USD     | 4.130.497         | 0,12                         |
| SANTANDER CONSUMER              |                          |         |                    |                              | ASTRAZENECA FINANCE                 |                          |         |                   |                              |
| FINANCE 3,75 % 17.01.29         | 12.000.000               | EUR     | 13.080.173         | 0,40                         | 4,85 % 26.02.29                     | 7.000.000                | USD     | 7.026.781         | 0,21                         |
|                                 |                          |         | <b>146.208.795</b> | <b>4,40</b>                  | AT & T 2,35 % 05.09.2029            | 9.500.000                | EUR     | 9.763.369         | 0,29                         |
| <b>SCHWEDEN</b>                 |                          |         |                    |                              | AT&T 7 % 30.04.40                   | 2.500.000                | GBP     | 3.626.651         | 0,11                         |
| ASSA ABLOY 4,125 %              |                          |         |                    |                              | ATHENE GLOBAL FUNDING               |                          |         |                   |                              |
| 13.09.35                        | 3.982.000                | EUR     | 4.587.589          | 0,14                         | 5,15 % 28.07.27                     | 3.000.000                | GBP     | 3.790.070         | 0,11                         |
| EPIROC 3,625 % 28.02.31         | 11.000.000               | EUR     | 11.934.362         | 0,35                         | ATT 5,4 % 15.02.34                  | 8.445.000                | USD     | 8.569.297         | 0,26                         |
| INVESTOR 1,5 % 20.06.2039       | 2.700.000                | EUR     | 2.251.408          | 0,07                         | BANK OF AMERICA 0,694 %             |                          |         |                   |                              |
|                                 |                          |         |                    |                              | VRN 22.03.31                        | 13.000.000               | EUR     | 11.894.540        | 0,36                         |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Corporate Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert   | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung                                  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert   | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--------------------------|---------|------------|------------------------------|---|--------------------------|---------|------------|------------------------------|
| BANK OF AMERICA 2,299 %<br>VRN 21.07.32                | 6.525.000                | USD     | 5.354.204  | 0,16                         | MERCK 4,3 % 17.05.30                          | 10.000.000               | USD     | 9.800.248  | 0,30                         |
| BANK OF AMERICA 5,468 %<br>VRN 23.01.35                | 635.000                  | USD     | 640.590    | 0,02                         | METLIFE 5,375 % 09.12.2024                    | 2.982.000                | GBP     | 3.769.415  | 0,11                         |
| BANK OF NEW YORK MELLON<br>4,947 % VRN 26.04.27        | 10.240.000               | USD     | 10.200.153 | 0,31                         | MORGAN STANLEY 5,164 %<br>VRN 20.04.29        | 1.300.000                | USD     | 1.299.949  | 0,04                         |
| BERKSHIRE HATHAWAY<br>FINANCE 2,375 % 19.06.39         | 303.000                  | GBP     | 279.830    | 0,01                         | MORGAN STANLEY 5,466 %<br>VRN 18.01.35        | 3.425.000                | USD     | 3.466.412  | 0,10                         |
| BOARDWALK PIPELINES<br>5,95 % 01.06.26                 | 5.763.000                | USD     | 5.819.006  | 0,18                         | MORGAN STANLEY 5,789 %<br>VRN 18.11.33        | 1.900.000                | GBP     | 2.523.439  | 0,08                         |
| BOOKING HOLDINGS 4 %<br>01/03/2044                     | 2.900.000                | EUR     | 3.187.090  | 0,10                         | MORGAN STANLEY 5,942 %<br>VRN 07.02.39        | 5.380.000                | USD     | 5.355.650  | 0,16                         |
| BOOKING HOLDINGS 4,75 %<br>15.11.34                    | 12.000.000               | EUR     | 14.294.979 | 0,44                         | MOTOROLA SOLUTIONS 5 %<br>15.04.29            | 3.530.000                | USD     | 3.515.930  | 0,11                         |
| BRANDYWINE OPERATING PART-<br>NERSHIP 4,1 % 01.10.2024 | 2.476.000                | USD     | 2.451.512  | 0,07                         | MOTOROLA SOLUTIONS 5,4 %<br>15.04.34          | 3.100.000                | USD     | 3.097.556  | 0,09                         |
| BRISTOLMYERS SQUIBB<br>5,9 % 15.11.33                  | 5.700.000                | USD     | 6.095.212  | 0,18                         | MPLX 5,65 % 01.03.53                          | 2.445.000                | USD     | 2.393.160  | 0,07                         |
| CISCO SYSTEMS 5,05 %<br>26.02.34                       | 4.670.000                | USD     | 4.739.600  | 0,14                         | MPT OPERATING PARTNERSHIP<br>3,375 % 24.04.30 | 500.000                  | GBP     | 425.226    | 0,01                         |
| CITIGROUP 8,125 %<br>15.07.39                          | 724.000                  | USD     | 928.155    | 0,03                         | NASDAQ 1,75 % 28.03.29                        | 11.000.000               | EUR     | 10.991.121 | 0,33                         |
| COCACOLA 3,45 % 25.03.2030                             | 5.000.000                | USD     | 4.710.350  | 0,14                         | NESTLE CAPITAL 4,5 %<br>22.03.29              | 2.306.000                | GBP     | 2.915.383  | 0,09                         |
| CVS HEALTH 5,875 %<br>01/06/2053                       | 3.345.000                | USD     | 3.414.268  | 0,10                         | NESTLE CAPITAL 4,75 %<br>22.03.36             | 3.000.000                | GBP     | 3.808.255  | 0,11                         |
| ELI LILLY 5 % 09.02.2054                               | 5.735.000                | USD     | 5.722.107  | 0,17                         | REALTY INCOME 6 %<br>05/12/2039               | 712.000                  | GBP     | 962.077    | 0,03                         |
| ENERGY TRANSFER 5,95 %<br>15.05.54                     | 2.925.000                | USD     | 2.923.095  | 0,09                         | SEMPRA ENERGY 5,5 %<br>01/08/2033             | 7.255.000                | USD     | 7.287.440  | 0,22                         |
| EXELON 5,15 % 15.03.29                                 | 3.190.000                | USD     | 3.199.173  | 0,10                         | SOUTHWESTERN ENERGY<br>4,75 % 01.02.32        | 7.000.000                | USD     | 6.450.706  | 0,19                         |
| FORD MOTOR CREDIT<br>6,798 % 07.11.28                  | 945.000                  | USD     | 986.867    | 0,03                         | SUNOCO LOGISTICS<br>PARTNERS 5,35 % 15.05.45  | 3.500.000                | USD     | 3.240.054  | 0,10                         |
| GENERAL MOTORS<br>FINANCIAL 5,75 % 08.02.31            | 1.725.000                | USD     | 1.745.207  | 0,05                         | SYNCHRONY BANK 5,4 %<br>22.08.25              | 5.510.000                | USD     | 5.464.348  | 0,16                         |
| GENERAL MOTORS<br>FINANCIAL 5,8 % 07.01.29             | 9.580.000                | USD     | 9.761.589  | 0,29                         | TARGA RESOURCES<br>PARTNERS 6,15 % 01.03.29   | 6.300.000                | USD     | 6.570.296  | 0,20                         |
| GLOBAL PAYMENTS 5,95 %<br>15.08.52                     | 8.280.000                | USD     | 8.297.205  | 0,25                         | TMOBILE 5,05 % 15.07.2033                     | 8.925.000                | USD     | 8.840.729  | 0,27                         |
| GOLDMAN SACHS GROUP<br>3,625 % VRN 29.10.29            | 1.511.000                | GBP     | 1.806.218  | 0,05                         | TMOBILE 5,5 % 15.01.55                        | 1.545.000                | USD     | 1.546.537  | 0,05                         |
| HCA 5,9 % 01.06.53                                     | 3.900.000                | USD     | 3.934.743  | 0,12                         | TMOBILE US 5,75 %<br>15.01.34                 | 2.640.000                | USD     | 2.755.216  | 0,08                         |
| HCA 6 % 01.04.54                                       | 7.655.000                | USD     | 7.795.344  | 0,23                         | TOYOTA MOTOR CREDIT<br>5,625 % 23.10.28       | 1.759.000                | GBP     | 2.322.091  | 0,07                         |
| HCA 6,1 % 01.04.64                                     | 10.325.000               | USD     | 10.479.006 | 0,32                         | UNITEDHEALTH GROUP<br>5,375 % 15.04.54        | 10.265.000               | USD     | 10.464.638 | 0,32                         |
| HUNTINGTON BANCSHARES<br>5,709 % VRN 02.02.35          | 21.405.000               | USD     | 21.367.533 | 0,65                         | US (GOVT) 3,875 %<br>15.02.43                 | 12.575.000               | USD     | 11.662.330 | 0,35                         |
| INTERNATIONAL BUSINESS<br>MACHINES 3,625 % 06.02.2031  | 7.900.000                | EUR     | 8.714.192  | 0,26                         | US (GOVT) 4 % 31.01.29                        | 11.887.000               | USD     | 11.776.952 | 0,35                         |
| JPMORGAN CHASE 1,963 %<br>VRN 23.03.30                 | 7.700.000                | EUR     | 7.772.073  | 0,23                         | US (GOVT) 4,125 %<br>15.02.27                 | 13.845.000               | USD     | 13.738.999 | 0,41                         |
| JPMORGAN CHASE 5,336 %<br>VRN 23.01.35                 | 4.535.000                | USD     | 4.558.631  | 0,14                         | US (GOVT) 4,25 %<br>28.02.31                  | 5.000.000                | USD     | 5.015.234  | 0,15                         |
| JPMORGAN CHASE 4,6 % VRN<br>PERP                       | 14.115.000               | USD     | 13.925.643 | 0,42                         | US (GOVT) 4,375 %<br>15.12.26                 | 11.000.000               | USD     | 10.981.523 | 0,33                         |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Corporate Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert             | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|----------------------|------------------------------|---|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|
| US (GOVT) 4,375 %<br>15.08.43   | 3.043.000                | USD     | 3.015.661            | 0,09                         | <b>FRANKREICH</b>   |                          |         |                   |                              |
| US (GOVT) 4,625 %<br>28.02.26   | 6.000.000                | USD     | 5.997.891            | 0,18                         | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT<br>MUTUEL 5,088 % 23.01.27          | 5.890.000                | USD     | 5.890.887         | 0,18                         |
| US (GOVT) 4,625 %<br>15.11.26   | 2.700.000                | USD     | 2.710.758            | 0,08                         | BNP PARIBAS 4,375 % VRN<br>01/03/2033                           | 15.325.000               | USD     | 14.542.979        | 0,44                         |
| US (GOVT) 4,75 %<br>15.11.53  | 13.033.000               | USD     | 13.955.492           | 0,42                         | CREDIT AGRICOLE 1,907 %<br>VRN 16.06.26                         | 6.065.000                | USD     | 5.801.392         | 0,17                         |
| US BANCORP 5,678 % VRN<br>23.01.35  | 3.915.000                | USD     | 3.961.667            | 0,12                         | CREDIT AGRICOLE 4,0 %<br>VRN 10.01.33                           | 5.545.000                | USD     | 5.169.581         | 0,16                         |
| VERIZON COMMUNICATIONS<br>3,375 % 27.10.36  | 2.308.000                | GBP     | 2.439.931            | 0,07                         | CREDIT AGRICOLE 5,514 %<br>05/07/2033                           | 7.480.000                | USD     | 7.665.241         | 0,23                         |
| VERIZON COMMUNICATIONS<br>4,75 % 31.10.34   | 11.000.000               | EUR     | 13.062.987           | 0,39                         | CREDIT AGRICOLE 6,316 %<br>VRN 03.10.29                         | 4.460.000                | USD     | 4.626.966         | 0,14                         |
| WASTE MANAGEMENT 4,875 %<br>15.02.29  | 16.970.000               | USD     | 17.151.188           | 0,53                         | CREDIT AGRICOLE 7,5 %<br>VRN PERP                               | 650.000                  | GBP     | 819.548           | 0,02                         |
| WESTFIELD AMERICA<br>MANAGE 2,625 % 30.03.29  | 300.000                  | GBP     | 332.946              | 0,01                         | GROUPE DES ASSURANCES DU CRE<br>1,85 % VRN 21.04.42             | 8.600.000                | EUR     | 7.655.310         | 0,23                         |
|   |                          |         | <b>484.593.871</b>   | <b>14,59</b>                 | SOCIETE GENERALE 1,25 %<br>07/12/2027                           | 1.000.000                | GBP     | 1.110.196         | 0,03                         |
| <b>SUMME ANLEIHEN</b>   |                          |         | <b>2.103.325.424</b> | <b>63,32</b>                 | SOCIETE GENERALE 5,634 %<br>VRN 19.01.30                        | 12.185.000               | USD     | 12.148.437        | 0,37                         |
| <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>   |                          |         |                      |                              | SOCIETE GENERALE 6,691 %<br>VRN 10.01.34                        | 2.750.000                | USD     | 2.888.675         | 0,09                         |
| <b>USA</b>  |                          |         |                      |                              |   |                          |         | <b>68.319.212</b> | <b>2,06</b>                  |
| BROADGATE FINANCING<br>5,098 % 05.04.35   | 500.000                  | GBP     | 515.835              | 0,02                         | <b>DEUTSCHLAND</b>  |                          |         |                   |                              |
|   |                          |         | <b>515.835</b>       | <b>0,02</b>                  | DEUTSCHE BANK 2,311 %<br>VRN 16.11.27                           | 6.640.000                | USD     | 6.072.955         | 0,18                         |
| <b>SUMME FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>                                       |                          |         | <b>515.835</b>       | <b>0,02</b>                  | DEUTSCHE BANK 3,742 %<br>VRN 07.01.33                           | 3.125.000                | USD     | 2.586.431         | 0,08                         |
| <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN<br/>BÖRSE NOTIERTEN WERTPAPIERE<br/>WERTPAPIERE</b> |                          |         | <b>2.103.841.259</b> | <b>63,34</b>                 |   |                          |         | <b>8.659.386</b>  | <b>0,26</b>                  |
| <b>AN EINEM ANDEREM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE, ÜBERTRAGBARE<br/>WERTPAPIERE</b>    |                          |         |                      |                              | <b>GROSSBRITANNIEN</b>  |                          |         |                   |                              |
| <b>ANLEIHEN</b>   |                          |         |                      |                              | ANGLO AMERICAN CAPITAL<br>4,125 % 15.03.32                      | 3.750.000                | EUR     | 4.066.815         | 0,12                         |
| <b>AUSTRALIEN</b>   |                          |         |                      |                              | BARCLAYS 3,75 % VRN<br>22.11.30                                 | 1.690.000                | GBP     | 2.049.726         | 0,06                         |
| AUSTRALIA NEW ZEALAND BANK<br>5,731 % VRN 18.09.34                                  | 4.000.000                | USD     | 3.984.771            | 0,12                         | BARCLAYS 8,875 % VRN PERP<br>BERKELEY GROUP 2,5 %<br>11/08/2031 | 476.000                  | GBP     | 466.956           | 0,01                         |
| QBE INSURANCE GROUP<br>2,5 % VRN 13.09.38   | 1.616.000                | GBP     | 1.755.970            | 0,05                         | BUPA FINANCE 4 % VRN PERP                                       | 599.000                  | GBP     | 555.732           | 0,02                         |
|   |                          |         | <b>5.740.741</b>     | <b>0,17</b>                  | DIRECT LINE INSURANCE<br>GROUP 4,75 % VRN PERP                  | 700.000                  | GBP     | 728.752           | 0,02                         |
| <b>BELGIEN</b>  |                          |         |                      |                              | HISCOX 6 % 22.09.27   | 727.000                  | GBP     | 935.941           | 0,03                         |
| KBC GROUP 6,324 % VRN<br>21.09.34   | 5.470.000                | USD     | 5.751.106            | 0,17                         | JUST GROUP 5 % VRN PERP   | 244.000                  | GBP     | 236.883           | 0,01                         |
|   |                          |         | <b>5.751.106</b>     | <b>0,17</b>                  | LLOYDS BANKING GROUP<br>4,75 % VRN 21.09.31                     | 5.504.000                | EUR     | 6.259.313         | 0,19                         |
| <b>KANADA</b>   |                          |         |                      |                              | LLOYDS BANKING GROUP<br>8,5 % VRN PERP                          | 525.000                  | GBP     | 677.858           | 0,02                         |
| BANK OF MONTREAL 1,25 %<br>15.09.26   | 5.500.000                | USD     | 5.024.524            | 0,15                         | MACQUARIE AIRFINANCE<br>HOLDINGS 6,4 % 26.03.29                 | 1.350.000                | USD     | 1.372.079         | 0,04                         |
| WASTE CONNECTIONS 4,2 %<br>15.01.33   | 1.380.000                | USD     | 1.300.641            | 0,04                         | NATIONWIDE BUILDING SOCIETY<br>2,972 % VRN 16.02.28             | 9.615.000                | USD     | 8.977.570         | 0,27                         |
|   |                          |         | <b>6.325.165</b>     | <b>0,19</b>                  |   |                          |         |                   |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Corporate Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|---|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|
| PENSION INSURANCE<br>7,375 % VRN PERP                     | 667.000                  | GBP     | 829.700           | 0,02                         | <b>LUXEMBURG</b>  |                          |         |                   |                              |
| RECKITT BENCKISER TREASURY<br>SERVICES 5,625 % 12.14.2038 | 648.000                  | GBP     | 863.354           | 0,03                         | BLACKSTONE PROPERTY PARTNERS<br>2,625 % 20.10.28        | 453.000                  | GBP     | 497.951           | 0,01                         |
| ROTHESAY LIFE 5 % VRN<br>PERP                             | 1.400.000                | GBP     | 1.361.860         | 0,04                         | SEGRO CAPITAL 0,5 %<br>22.09.31                         | 4.600.000                | EUR     | 3.937.469         | 0,12                         |
| ROTHESAY LIFE 5,5 % VRN<br>17.09.29                       | 300.000                  | GBP     | 377.254           | 0,01                         |   |                          |         | <b>4.435.420</b>  | <b>0,13</b>                  |
| SANCTUARY CAPITAL<br>2,375 % 14.04.50                     | 1.038.000                | GBP     | 803.025           | 0,02                         | <b>NIEDERLANDE</b>                                      |                          |         |                   |                              |
| SKY 2,75 % 27.11.29                                       | 9.300.000                | EUR     | 9.843.169         | 0,31                         | ASR NEDERLAND 3,375 %<br>VRN 02.05.49                   | 9.900.000                | EUR     | 10.111.426        | 0,30                         |
| SOUTHERN GAS NETWORKS<br>6,625 % 14.03.35                 | 1.573.000                | GBP     | 2.183.106         | 0,07                         | COOPERATIEVE RABOBANK<br>3,758 % VRN 06.04.33           | 10.100.000               | USD     | 9.037.527         | 0,27                         |
| WESTFIELD STRATFORD CITY<br>FINANCE 1,642 % 04.08.31      | 695.000                  | GBP     | 795.885           | 0,02                         | COOPERATIEVE RABOBANK<br>5,041 % 05.03.27               | 14.550.000               | USD     | 14.607.756        | 0,45                         |
| YORKSHIRE WATER FINANCE<br>2,75 % 18.04.41                | 1.926.000                | GBP     | 1.671.211         | 0,05                         | DIGITAL DUTCH FINCO<br>0,625 % 15.07.25                 | 6.800.000                | EUR     | 7.042.941         | 0,21                         |
|   |                          |         | <b>46.344.858</b> | <b>1,40</b>                  | ENEL FINANCE INTERNATIONAL<br>4,75 % 25.05.47           | 3.480.000                | USD     | 2.991.804         | 0,09                         |
| <b>IRLAND</b>   |                          |         |                   |                              | ENEL FINANCE INTERNATIONAL<br>5,5 % 15.06.52            | 2.960.000                | USD     | 2.785.395         | 0,08                         |
| AERCAP IRELAND CAPITAL<br>3,5 % 15.01.25                  | 16.025.000               | USD     | 15.773.643        | 0,47                         | IBERDROLA INTERNATIONAL<br>3,25 % VRN PERP              | 8.600.000                | EUR     | 9.199.853         | 0,28                         |
| AIB GROUP 5,871 % VRN<br>28.03.35                         | 3.515.000                | USD     | 3.533.548         | 0,11                         | ING GROEP 0,25 % VRN<br>18.02.29                        | 8.800.000                | EUR     | 8.340.106         | 0,25                         |
| AIB GROUP 6,608 % VRN<br>13.09.29                         | 3.495.000                | USD     | 3.646.128         | 0,11                         | JAB HOLDINGS 1,75 %<br>25.06.26                         | 9.600.000                | EUR     | 9.950.723         | 0,30                         |
| AVOLON HOLDINGS FUNDING<br>2,125 % 21.02.26               | 4.000.000                | USD     | 3.731.193         | 0,11                         | NXP FUNDING 3,125 %<br>15.02.42                         | 14.320.000               | USD     | 10.340.400        | 0,31                         |
| AVOLON HOLDINGS FUNDING<br>3,95 % 01.07.24                | 7.195.000                | USD     | 7.155.232         | 0,22                         | THERMO FISHER<br>SCIENTIFIC FINANCE 0,8 %<br>18/10/2030 | 4.253.000                | EUR     | 3.966.842         | 0,12                         |
| AVOLON HOLDINGS FUNDING<br>4,25 % 15.04.26                | 2.887.000                | USD     | 2.790.319         | 0,08                         |   |                          |         | <b>88.374.773</b> | <b>2,66</b>                  |
| BANK OF IRELAND GROUP<br>5,601 % VRN 20.03.30             | 3.375.000                | USD     | 3.377.167         | 0,10                         | <b>NEUSEELAND</b>                                       |                          |         |                   |                              |
| SMURFIT KAPPA TREASURY<br>5,2 % 15.01.30                  | 3.775.000                | USD     | 3.772.302         | 0,11                         | BANK OF NEW ZEALAND<br>5,076 % 30.01.29                 | 11.505.000               | USD     | 11.506.208        | 0,35                         |
| SMURFIT KAPPA TREASURY<br>5,777 % 03.04.54                | 2.645.000                | USD     | 2.645.000         | 0,08                         |   |                          |         | <b>11.506.208</b> | <b>0,35</b>                  |
| ZURICH FINANCE IRELAND<br>5,125 % VRN 23.11.52            | 2.344.000                | GBP     | 2.887.221         | 0,09                         | <b>SPANIEN</b>  |                          |         |                   |                              |
|   |                          |         | <b>49.311.753</b> | <b>1,48</b>                  | CAIXABANK 5,673 % VRN<br>15.03.30                       | 5.375.000                | USD     | 5.376.276         | 0,16                         |
| <b>ITALIEN</b>  |                          |         |                   |                              | CAIXABANK 6,037 % VRN<br>15.06.35                       | 5.375.000                | USD     | 5.430.776         | 0,17                         |
| ENI 3,625 % 19.05.27                                      | 12.019.000               | EUR     | 13.064.214        | 0,39                         |   |                          |         | <b>10.807.052</b> | <b>0,33</b>                  |
| INTESA SANPAOLO 4,198 %<br>01/06/2032                     | 3.695.000                | USD     | 3.097.249         | 0,09                         | <b>SCHWEDEN</b>   |                          |         |                   |                              |
| INTESA SANPAOLO 6,625 %<br>20.06.33                       | 5.295.000                | USD     | 5.510.511         | 0,17                         | SKANDINAVISKA ENSKILDA<br>BANKEN 5,125 % 05.03.27       | 6.360.000                | USD     | 6.375.664         | 0,19                         |
| INTESA SANPAOLO 7,2 %<br>28.11.33                         | 3.385.000                | USD     | 3.660.505         | 0,11                         | SVENSKA HANDELSBANKEN<br>0,05 % 06.09.28                | 14.497.000               | EUR     | 13.673.325        | 0,41                         |
| INTESA SANPAOLO 7,8 %<br>28.11.53                         | 2.370.000                | USD     | 2.692.354         | 0,08                         | SVENSKA HANDELSBANKEN<br>4,625 % VRN 23.08.32           | 1.874.000                | GBP     | 2.284.314         | 0,07                         |
|   |                          |         | <b>28.024.833</b> | <b>0,84</b>                  |   |                          |         | <b>22.333.303</b> | <b>0,67</b>                  |
|   |                          |         |                   |                              | <b>SCHWEIZ</b>  |                          |         |                   |                              |
|   |                          |         |                   |                              | CREDIT SUISSE 1,25 %<br>07/08/2026                      | 5.000.000                | USD     | 4.562.604         | 0,14                         |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Corporate Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung                                    | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert   | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|---|--------------------------|---------|------------|------------------------------|
| CREDIT SUISSE NEW YORK<br>FRN 21.02.25          | 26.510.000               | USD     | 26.628.862        | 0,80                         | BROADCOM 4,926 %<br>15.05.37                                  | 4.544.000                | USD     | 4.323.438  | 0,13                         |
|   |                          |         | <b>31.191.466</b> | <b>0,94</b>                  | CAPITAL ONE FINANCIAL<br>5,817 % VRN 01.02.34                 | 4.270.000                | USD     | 4.272.705  | 0,13                         |
| <b>USA</b>                                      |                          |         |                   |                              | CARE CAPITAL PROPERTIES<br>5,125 % 15.08.26                   | 1.845.000                | USD     | 1.832.203  | 0,06                         |
| ABBVIE 5,4 % 15.03.54                           | 5.560.000                | USD     | 5.735.506         | 0,17                         | CENTENE 3 % 15.10.30  | 1.460.000                | USD     | 1.253.055  | 0,04                         |
| AIR PRODUCTS AND CHEMICALS<br>4,85 % 08.02.34   | 10.000.000               | USD     | 9.907.171         | 0,30                         | CHARTER COMMUNICATIONS<br>OPERATING 3,5 % 01.06.2041          | 3.865.000                | USD     | 2.609.595  | 0,08                         |
| AIRCASTLE 2,85 %<br>26.01.28                    | 14.100.000               | USD     | 12.673.764        | 0,38                         | CHARTER COMMUNICATIONS<br>OPERATING 4,8 % 01.03.50            | 700.000                  | USD     | 518.937    | 0,02                         |
| AIRCASTLE 5,25 %<br>11/08/2025                  | 21.885.000               | USD     | 21.693.304        | 0,65                         | CHARTER COMMUNICATIONS<br>OPERATING 5,125 % 07.01.49          | 6.200.000                | USD     | 4.821.218  | 0,15                         |
| AMAZONCOM 3,95 %<br>13.04.52                    | 10.000.000               | USD     | 8.443.028         | 0,25                         | CHARTER COMMUNICATION OPERATING<br>5,375 % 04.01.38           | 4.100.000                | USD     | 3.572.437  | 0,11                         |
| AMGEN 4,2 % 22.02.52                            | 13.000.000               | USD     | 10.727.231        | 0,32                         | CHARTER COMMUNICATIONS OPERATING<br>5,75 % 01.04.48           | 12.115.000               | USD     | 10.222.990 | 0,31                         |
| AMGEN 4,875 % 01.03.53                          | 5.500.000                | USD     | 5.023.374         | 0,15                         | CHARTER COMMUNICATION OPERATING<br>CAPITAL 5,375 % 01.05.2047 | 600.000                  | USD     | 485.207    | 0,01                         |
| APPLE 0 % 15.11.25                              | 11.000.000               | EUR     | 11.276.028        | 0,34                         | CITIGROUP 4,7 % VRN PERP<br>CITIGROUP 5,827 % VRN             | 3.050.000                | USD     | 2.986.707  | 0,09                         |
| APPLE 2,7 % 05.08.51                            | 10.000.000               | USD     | 6.646.796         | 0,20                         | 13.02.35  | 9.060.000                | USD     | 8.975.145  | 0,27                         |
| ATHENE GLOBAL FUNDING<br>5,516 % 25.03.27       | 19.155.000               | USD     | 19.178.842        | 0,58                         | COLGATEPALMOLIVE 1,375 %<br>06/03/2034                        | 7.800.000                | EUR     | 7.248.659  | 0,22                         |
| ATT 3,5 % 15.09.53                              | 3.090.000                | USD     | 2.186.383         | 0,07                         | CONSTELLATION BRANDS<br>4,35 % 09.05.27                       | 14.800.000               | USD     | 14.516.470 | 0,44                         |
| AVIATION CAPITAL GROUP<br>1,95 % 30.01.26       | 4.630.000                | USD     | 4.325.827         | 0,13                         | DAE FUNDING 1,55 %<br>01/08/2024                              | 6.190.000                | USD     | 6.100.440  | 0,18                         |
| AVIATION CAPITAL GROUP<br>1,95 % 20.09.26       | 7.590.000                | USD     | 6.941.982         | 0,21                         | DELL INTERNATIONAL<br>3,45 % 15.12.51                         | 2.530.000                | USD     | 1.782.027  | 0,05                         |
| AVIATION CAPITAL GROUP<br>6,375 % 15.07.30      | 3.455.000                | USD     | 3.561.542         | 0,11                         | DELL INTERNATIONAL 4,9 %<br>01/10/2026                        | 12.535.000               | USD     | 12.467.052 | 0,38                         |
| AVOLON HOLDINGS FUNDING<br>5,5 % 15.01.26       | 10.875.000               | USD     | 10.779.151        | 0,32                         | DELL INTERNATIONAL<br>6,02 % 15.06.26                         | 1.119.000                | USD     | 1.134.403  | 0,03                         |
| BANK OF AMERICA 2,482 %<br>VRN 21.09.36         | 10.845.000               | USD     | 8.676.871         | 0,26                         | ENEL FINANCE AMERICA<br>2,875 % 12.07.41                      | 19.785.000               | USD     | 13.504.210 | 0,41                         |
| BANK OF AMERICA 2,972 %<br>VRN 04.02.33         | 30.000.000               | USD     | 25.518.698        | 0,76                         | ENERGY TRANSFER OPERATING<br>6,25 % 15.04.49                  | 3.560.000                | USD     | 3.667.807  | 0,11                         |
| BANK OF AMERICA 4,571 %<br>VRN 27.04.33         | 1.765.000                | USD     | 1.678.830         | 0,05                         | ENERGY TRANSFER<br>PARTNERS 5,15 % 01.02.43                   | 6.000.000                | USD     | 5.396.452  | 0,16                         |
| BANK OF NEW YORK MELLON<br>4,975 % VRN 14.03.30 | 3.605.000                | USD     | 3.610.347         | 0,11                         | ENERGY TRANSFER<br>PARTNERS 5,3 % 15.04.47                    | 2.965.000                | USD     | 2.708.902  | 0,08                         |
| BERKSHIRE HATHAWAY<br>1,125 % 16.03.27          | 9.200.000                | EUR     | 9.346.886         | 0,28                         | ENERGY TRANSFER<br>PARTNERS 6 % 15.06.48                      | 1.705.000                | USD     | 1.703.004  | 0,05                         |
| BERKSHIRE HATHAWAY<br>FINANCE 3,85 % 15.03.52   | 5.000.000                | USD     | 4.058.639         | 0,12                         | EQUINIX 1,45 % 15.05.2026                                     | 16.820.000               | USD     | 15.486.349 | 0,47                         |
| BMW US CAPITAL 4,9 %<br>02/04/2029              | 3.225.000                | USD     | 3.225.290         | 0,10                         | FISERV 3 % 01.07.31   | 1.396.000                | GBP     | 1.562.125  | 0,05                         |
| BOARDWALK PIPELINES<br>3,4 % 15.02.31           | 4.745.000                | USD     | 4.220.392         | 0,13                         | FISERV 5,35 % 15.03.31  | 3.630.000                | USD     | 3.676.119  | 0,11                         |
| BRISTOLMYERS SQUIBB<br>5,2 % 22.02.34           | 3.425.000                | USD     | 3.485.154         | 0,10                         | FIVE CORNERS FUNDING<br>TRUST 5,997 % 15.02.53                | 6.695.000                | USD     | 7.106.417  | 0,21                         |
| BROADCOM 3,187 %<br>15.11.36                    | 12.929.000               | USD     | 10.313.232        | 0,31                         | FORD MOTOR CREDIT 6,05 %<br>05/03/2031                        | 10.690.000               | USD     | 10.788.799 | 0,32                         |
| BROADCOM 3,5 % 15.02.41                         | 6.560.000                | USD     | 5.107.300         | 0,15                         |   |                          |         |            |                              |
| BROADCOM 4,15 % 15.04.32                        | 11.565.000               | USD     | 10.744.460        | 0,32                         |   |                          |         |            |                              |
| BROADCOM 4,15 % 15.11.30                        | 3.353.000                | USD     | 3.176.077         | 0,10                         |   |                          |         |            |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Corporate Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung                                      | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert   | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert             | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|------------|------------------------------|---|--------------------------|---------|----------------------|------------------------------|
| FORTUNE BRANDS HOME SECURITY 4,5 % 25.03.2052     | 8.680.000                | USD     | 7.164.981  | 0,22                         | SYNCHRONY FINANCIAL 2,875 % 28.10.31  | 5.495.000                | USD     | 4.401.128            | 0,13                         |
| GENERAL MOTORS 6,75 % 01/04/2046                  | 1.700.000                | USD     | 1.840.224  | 0,06                         | SYNCHRONY FINANCIAL 4,875 % 13.06.25  | 10.330.000               | USD     | 10.182.449           | 0,31                         |
| GENERAL MOTORS FINANCIAL FRN 07.04.2025           | 18.720.000               | USD     | 18.850.357 | 0,57                         | TARGA RESOURCES 4,95 % 15.04.52   | 17.805.000               | USD     | 15.674.922           | 0,47                         |
| GLOBAL PAYMENTS 1,5 % 15.11.24                    | 6.570.000                | USD     | 6.405.424  | 0,19                         | TEXAS INSTRUMENTS 2,7 % 15.09.51  | 8.095.000                | USD     | 5.285.622            | 0,16                         |
| GLOBAL PAYMENTS 4,15 % 15.08.49                   | 3.665.000                | USD     | 2.850.112  | 0,09                         | TIME WARNER CABLE 5,25 % 15.07.42   | 1.450.000                | GBP     | 1.557.937            | 0,05                         |
| GLP CAPITAL LP GLP FINANCING 6,75 % 12.01.33      | 3.610.000                | USD     | 3.808.187  | 0,11                         | TIME WARNER CABLE 5,75 % 02/06/2031   | 800.000                  | GBP     | 981.797              | 0,03                         |
| GOLDMAN SACHS BANK 5,283 % VRN 18.03.27           | 18.865.000               | USD     | 18.860.997 | 0,57                         | TMOBILE USA 3,5 % 15.04.31  | 13.000.000               | USD     | 11.747.175           | 0,35                         |
| HCA 4,625 % 15.03.52                              | 2.720.000                | USD     | 2.283.128  | 0,07                         | TMOBILE USA 3,875 % 15.04.30  | 10.000.000               | USD     | 9.376.594            | 0,28                         |
| HCA 5,125 % 15.06.39                              | 5.560.000                | USD     | 5.268.049  | 0,16                         | TRUIST FINANCIAL 5,711 % VRN 24.01.35   | 6.250.000                | USD     | 6.291.150            | 0,19                         |
| JACKSON FINANCIAL 3,125 % 23.11.31                | 4.155.000                | USD     | 3.471.824  | 0,10                         | US (GOVT) 3,25 % 15.05.42   | 2.940.000                | USD     | 2.507.039            | 0,08                         |
| JPMORGAN CHASE 2,963 % VRN 25.01.33               | 14.000.000               | USD     | 11.986.639 | 0,36                         | US (GOVT) 4 % 15.02.34  | 1.800.000                | USD     | 1.773.141            | 0,05                         |
| JPMORGAN CHASE 4,586 % VRN 26.04.33               | 3.335.000                | USD     | 3.200.562  | 0,10                         | US (GOVT) 4 % 15.11.52  | 23.000.000               | USD     | 21.693.671           | 0,65                         |
| KENNAMETAL 2,8 % 01/03/2031                       | 3.445.000                | USD     | 2.927.801  | 0,09                         | US (GOVT) 4,25 % 28.02.29   | 23.877.000               | USD     | 23.932.028           | 0,72                         |
| KENNAMETAL 4,625 % 15.06.28                       | 5.060.000                | USD     | 4.979.168  | 0,15                         | WARNERMEDIA HOLDINGS 5,05 % 15.03.42  | 12.345.000               | USD     | 10.616.921           | 0,32                         |
| LOWES 4,25 % 01.04.52                             | 2.845.000                | USD     | 2.338.776  | 0,07                         | WASTE MANAGEMENT 4,15 % 15.04.32  | 10.780.000               | USD     | 10.324.516           | 0,31                         |
| LSEGE US FIN 4,875 % 28.03.27                     | 3.000.000                | USD     | 2.990.902  | 0,09                         | <b>SUMME ANLEIHEN</b>   |                          |         | <b>687.186.616</b>   | <b>20,69</b>                 |
| MARS 4,65 % 20.04.31                              | 10.000.000               | USD     | 9.890.103  | 0,30                         | <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN MARKT GEHANDELTEN ÜBERTRAGBAREN WERTPAPIERE</b> |                          |         | <b>1.074.311.892</b> | <b>32,34</b>                 |
| MERCEDESSENZ FINANCE NORTH AMERICA 5,1 % 08.03.28 | 3.155.000                | USD     | 3.172.082  | 0,10                         | <b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>  |                          |         |                      |                              |
| MERCK 2,75 % 10.12.51                             | 5.000.000                | USD     | 3.284.831  | 0,10                         | <b>IRLAND</b>   |                          |         |                      |                              |
| MORGAN STANLEY 1,164 % VRN 21.10.25               | 8.750.000                | USD     | 8.522.161  | 0,26                         | HSBC GLOBAL LIQUIDITY FUND  | 11.900.175               | USD     | 11.900.175           | 0,36                         |
| MORGAN STANLEY 2,484 % VRN 16.09.36               | 7.285.000                | USD     | 5.765.703  | 0,17                         | HSBC STERLING ESG LIQUIDITY FUND „Y INC“  | 9.089.289                | GBP     | 11.482.044           | 0,35                         |
| MPLX 4,95 % 01.09.32                              | 2.285.000                | USD     | 2.223.709  | 0,07                         | HSBC US DOLLAR ESG LIQUIDITY FUND Y INC   | 14                       | USD     | 14                   | 0,00                         |
| MPLX 5,2 % 01.03.47                               | 3.065.000                | USD     | 2.819.043  | 0,08                         |   |                          |         | <b>23.382.233</b>    | <b>0,71</b>                  |
| MPLX 5,5 % 15.02.49                               | 3.585.000                | USD     | 3.428.922  | 0,10                         | <b>LUXEMBURG</b>  |                          |         |                      |                              |
| NEWMONT CORP NEWCREST FINANCE 5,35 % 15.03.34     | 5.775.000                | USD     | 5.815.225  | 0,18                         | HGIF GLOBAL ASSET BACKED BOND „Z“   | 371.642                  | USD     | 63.932.487           | 1,92                         |
| NIAGARA MOHAWK POWER 5,684 % 17.01.54             | 2.410.000                | USD     | 2.406.764  | 0,07                         | <b>SUMME ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>                                  |                          |         | <b>63.932.487</b>    | <b>1,92</b>                  |
| PEPSICO 2,75 % 21.10.2051                         | 5.000.000                | USD     | 3.353.352  | 0,10                         |   |                          |         | <b>87.314.720</b>    | <b>2,63</b>                  |
| PVH CORP 3,125 % 15.12.27                         | 5.106.000                | EUR     | 5.425.734  | 0,16                         |   |                          |         |                      |                              |
| SABRA HEALTH CARE 3,9 % 15.10.29                  | 3.990.000                | USD     | 3.603.110  | 0,11                         |   |                          |         |                      |                              |
| SANTANDER HOLDINGS 4,5 % 17.07.25                 | 5.000.000                | USD     | 4.917.679  | 0,15                         |   |                          |         |                      |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Corporate Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung                                   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert             | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--------------------------|---------|----------------------|------------------------------|
| <b>SONSTIGE ÜBERTRAGBARE<br/>WERTPAPIERE</b>   |                          |         |                      |                              |
| <b>ANLEIHEN</b>                                |                          |         |                      |                              |
| <b>FRANKREICH</b>                              |                          |         |                      |                              |
| BNP PARIBAS 2,588 % VRN<br>12/08/2035          | 4.445.000                | USD     | 3.646.679            | 0,11                         |
|  |                          |         | <b>3.646.679</b>     | <b>0,11</b>                  |
| <b>SUMME ANLEIHEN</b>                          |                          |         | <b>3.646.679</b>     | <b>0,11</b>                  |
| <b>SUMME SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |                          |         | <b>3.646.679</b>     | <b>0,11</b>                  |
| <b>SUMME WERTPAPIERANLAGEN</b>                 |                          |         | <b>3.269.114.550</b> | <b>98,42</b>                 |
| <b>SONSTIGES NETTOVERMÖGEN</b>                 |                          |         | <b>52.350.066</b>    | <b>1,58</b>                  |
| <b>GESAMTNETTOVERMÖGEN</b>                     |                          |         | <b>3.321.464.616</b> | <b>100,00</b>                |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Emerging Markets Bond

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|--|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|
| <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>  |                          |         |                   |                              | <b>EMPRESA NACIONAL DEL PETROLEO 6,15 % 10.05.33</b> |                          |         |                   |                              |
| <b>AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |                          |         |                   |                              | <b>CHINA</b>   |                          |         |                   |                              |
| <b>ANLEIHEN</b>   |                          |         |                   |                              | SHIMAO PROPERTY HOLDINGS 6,125 % 21.02.2024*         |                          |         |                   |                              |
| <b>ANGOLA</b>   |                          |         |                   |                              | TIMES CHINA HOLDINGS 5,75 % 14.01.27                 |                          |         |                   |                              |
| ANGOLA (GOVT) 8,25 %<br>09/05/2028                                | 2.000.000                | USD     | 1.931.790         | 0,19                         | ZHENRO PROPERTIES GROUP 7,1 % 10.09.24               | 1.100.000                | USD     | 14.480            | 0,00                         |
| ANGOLA (GOVT) 9,5 %<br>12/11/2025                                 | 2.000.000                | USD     | 2.039.920         | 0,20                         |  |                          |         | <b>214.197</b>    | <b>0,02</b>                  |
|   |                          |         | <b>3.971.710</b>  | <b>0,39</b>                  | <b>KOLUMBIEN</b>                                     |                          |         |                   |                              |
| <b>ARGENTINIEN</b>  |                          |         |                   |                              | COLOMBIA (GOVT) 6,125 %<br>18.01.41                  |                          |         |                   |                              |
| ARGENTINA (GOVT) 0,125 %<br>09/07/2035                            | 20.112.516               | USD     | 8.547.819         | 0,84                         | COLOMBIA (GOVT) 8 %<br>14.11.35                      | 2.400.000                | USD     | 2.082.855         | 0,20                         |
|   |                          |         | <b>8.547.819</b>  | <b>0,84</b>                  | COLOMBIA (GOVT) 8,75 %<br>14.11.53                   | 5.000.000                | USD     | 5.265.908         | 0,51                         |
| <b>ASERBAIDSCHAN</b>  |                          |         |                   |                              | ECOPETROL 8,375 %<br>19.01.36                        |                          |         |                   |                              |
| AZERBAIJAN (GOVT) 3,5 %<br>01/09/2032                             | 3.000.000                | USD     | 2.552.471         | 0,25                         | ECOPETROL 8,625 %<br>19.01.29                        | 2.000.000                | USD     | 2.016.031         | 0,20                         |
| SOUTHERN GAS CORRIDOR<br>6,875 % 24.03.26                         | 1.500.000                | USD     | 1.517.683         | 0,15                         | ECOPETROL 8,875 %<br>13.01.33                        | 6.400.000                | USD     | 6.787.249         | 0,66                         |
|   |                          |         | <b>4.070.154</b>  | <b>0,40</b>                  |  | 5.000.000                | USD     | 5.298.904         | 0,52                         |
| <b>BAHRAIN</b>  |                          |         |                   |                              | <b>DOMINIKANISCHE REPUBLIK</b>                       |                          |         |                   |                              |
| BAHRAIN (GOVT) 6,75 %<br>20.09.29                                 | 2.500.000                | USD     | 2.529.681         | 0,25                         | DOMINIKANISCHE REPUBLIK<br>(GOVT) 7,05 % 03.02.31    | 3.950.000                | USD     | 4.098.003         | 0,40                         |
| BAHRAIN (GOVT) 7 %<br>12/10/2028                                  | 3.400.000                | USD     | 3.511.301         | 0,34                         |  |                          |         | <b>4.098.003</b>  | <b>0,40</b>                  |
|   |                          |         | <b>6.040.982</b>  | <b>0,59</b>                  | <b>ÄGYPTEN</b>                                       |                          |         |                   |                              |
| <b>BENIN</b>  |                          |         |                   |                              | EGYPT (GOVT) 5,25 %<br>06/10/2025                    |                          |         |                   |                              |
| BENIN (GOVT) 7,96 %<br>13.02.38                                   | 5.500.000                | USD     | 5.367.989         | 0,52                         | EGYPT (GOVT) 7,3 %<br>30.09.33                       | 1.865.000                | USD     | 1.799.657         | 0,18                         |
|   |                          |         | <b>5.367.989</b>  | <b>0,52</b>                  | EGYPT (GOVT) 7,625 %<br>29.05.32                     | 4.600.000                | USD     | 3.784.119         | 0,37                         |
| <b>BERMUDA</b>  |                          |         |                   |                              | EGYPT (GOVT) 7,903 %<br>21.02.48                     |                          |         |                   |                              |
| CBQ FINANCE 5,375 %<br>28.03.29                                   | 6.800.000                | USD     | 6.777.091         | 0,66                         | EGYPT (GOVT) 8,50 %<br>31.01.47                      | 5.500.000                | USD     | 4.188.638         | 0,41                         |
|   |                          |         | <b>6.777.091</b>  | <b>0,66</b>                  | EGYPT (GOVT) 8,7002 %<br>01/03/2049                  | 4.480.000                | USD     | 3.566.844         | 0,35                         |
| <b>BRASILIEN</b>  |                          |         |                   |                              | EGYPT (GOVT) 8,75 %<br>30.09.51                      |                          |         |                   |                              |
| BRAZIL (GOVT) 10 %<br>01/01/2033                                  | 78.400                   | BRL     | 14.915.315        | 1,46                         |  | 7.000.000                | USD     | 5.690.992         | 0,56                         |
| BRAZILIAN (GOVT) 7,125 %<br>13.05.54                              | 4.000.000                | USD     | 4.037.063         | 0,39                         |  |                          |         | <b>24.952.205</b> | <b>2,45</b>                  |
|   |                          |         | <b>18.952.378</b> | <b>1,85</b>                  | <b>EL SALVADOR</b>                                   |                          |         |                   |                              |
| <b>CHILE</b>  |                          |         |                   |                              | EL SALVADOR (GOVT)<br>7,65 % 15.06.35                |                          |         |                   |                              |
| CORP NACIONAL DEL COBRE<br>5,125 % 02.02.33                       | 9.500.000                | USD     | 9.037.995         | 0,88                         | EL SALVADOR (GOVT)<br>8,25 % 10.04.32                | 1.910.000                | USD     | 1.461.706         | 0,14                         |
| CORP NACIONAL DEL COBRE<br>5,95 % 08.01.34                        | 2.300.000                | USD     | 2.305.621         | 0,23                         | EL SALVADOR (GOVT)<br>8,625 % 28.02.29               | 10.050.000               | USD     | 8.387.636         | 0,82                         |
| CORP NACIONAL DEL COBRE<br>DE CHILE 6,3 % 08.09.53                | 9.800.000                | USD     | 9.758.699         | 0,95                         |  | 1.500.000                | USD     | 1.311.130         | 0,13                         |
| CORP NACIONAL DEL COBRE<br>DE CHILE 6,44 % 26.01.36               | 3.600.000                | USD     | 3.722.020         | 0,36                         |  |                          |         | <b>11.160.472</b> | <b>1,09</b>                  |

\* Der Vermögenswert, der am 21. Februar 2024 fällig war, ist notleidend. Der Ausschuss für die Preisbestimmung die und Verwaltungsgesellschaft haben vereinbart, den letzten am Markt verfügbaren Preis zu verwenden.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Emerging Markets Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung             | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung            | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------------|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|-------------------------|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|
| <b>GABUN</b>             |                          |         |                   |                              | PERTAMINA 6,45 %        |                          |         |                   |                              |
| GABONESE (GOVT) 6,95 %   |                          |         |                   |                              | 30.05.44                | 4.370.000                | USD     | 4.670.719         | 0,46                         |
| 16.06.25                 | 4.630.000                | USD     | 4.551.246         | 0,44                         | PERTAMINA PERSERO 3,1 % |                          |         |                   |                              |
|                          |                          |         | <b>4.551.246</b>  | <b>0,44</b>                  | 21.01.30                | 2.000.000                | USD     | 1.793.211         | 0,18                         |
| <b>GHANA</b>             |                          |         |                   |                              | PERUSAHAAN LISTRIK      |                          |         |                   |                              |
| GHANA (GOVT) 7,625 %     |                          |         |                   |                              | NEGARA 4,125 % 15.05.27 | 5.000.000                | USD     | 4.822.724         | 0,47                         |
| 16.05.29                 | 800.000                  | USD     | 414.181           | 0,04                         | PERUSAHAAN PERSEROAN    |                          |         |                   |                              |
| GHANA (GOVT) 7,875 %     |                          |         |                   |                              | PERSERO 3 % 30.06.30    | 3.000.000                | USD     | 2.621.058         | 0,26                         |
| 26.03.27                 | 9.150.000                | USD     | 4.752.348         | 0,47                         |                         |                          |         | <b>28.974.188</b> | <b>2,84</b>                  |
| GHANA (GOVT) 7,875 %     |                          |         |                   |                              | <b>IRAK</b>             |                          |         |                   |                              |
| 11/02/2035               | 3.800.000                | USD     | 1.961.271         | 0,19                         | IRAQ (GOVT) 5,8 %       |                          |         |                   |                              |
| GHANA (GOVT) 8,627 %     |                          |         |                   |                              | 15.01.28                | 8.500.000                | USD     | 4.014.866         | 0,39                         |
| 16.06.49                 | 4.870.000                | USD     | 2.467.857         | 0,24                         |                         |                          |         | <b>4.014.866</b>  | <b>0,39</b>                  |
| GHANA (GOVT) 8,75 %      |                          |         |                   |                              | <b>ISRAEL</b>           |                          |         |                   |                              |
| 11/03/2061               | 1.000.000                | USD     | 513.787           | 0,05                         | ISRAEL (GOVT) 5,75 %    |                          |         |                   |                              |
| GHANA (GOVT) 8,95 %      |                          |         |                   |                              | 12/03/2054              | 3.000.000                | USD     | 2.883.276         | 0,28                         |
| 26.03.51                 | 3.000.000                | USD     | 1.540.364         | 0,15                         |                         |                          |         | <b>2.883.276</b>  | <b>0,28</b>                  |
|                          |                          |         | <b>11.649.808</b> | <b>1,14</b>                  | <b>Elfenbeinküste</b>   |                          |         |                   |                              |
| <b>GUATEMALA</b>         |                          |         |                   |                              | AFRICAN DEVELOPMENT     |                          |         |                   |                              |
| GUATEMALA (GOVT) 6,125 % |                          |         |                   |                              | BANK 5,75 % VRN PERP    | 2.700.000                | USD     | 2.636.711         | 0,26                         |
| 01/06/2050               | 3.170.000                | USD     | 2.952.187         | 0,29                         | IVORY COAST (GOVT)      |                          |         |                   |                              |
|                          |                          |         | <b>2.952.187</b>  | <b>0,29</b>                  | 6,125 % 15.06.33        | 11.600.000               | USD     | 10.492.154        | 1,03                         |
| <b>HONGKONG</b>          |                          |         |                   |                              | IVORY COAST (GOVT)      |                          |         |                   |                              |
| SHIMAO PROPERTY          |                          |         |                   |                              | 7,625 % 30.01.33        | 5.850.000                | USD     | 5.816.131         | 0,57                         |
| HOLDINGS 5,2 % 30.01.25  | 918.000                  | USD     | 36.084            | 0,00                         | IVORY COAST (GOVT)      |                          |         |                   |                              |
|                          |                          |         | <b>36.084</b>     | <b>0,00</b>                  | 8,25 % 30.01.37         | 6.950.000                | USD     | 6.983.808         | 0,68                         |
| <b>HUNGARN</b>           |                          |         |                   |                              |                         |                          |         |                   |                              |
| HUNGARY (GOVT) 3,125 %   |                          |         |                   |                              |                         |                          |         | <b>25.928.804</b> | <b>2,54</b>                  |
| 21.09.51                 | 2.000.000                | USD     | 1.268.500         | 0,12                         | <b>KASACHSTAN</b>       |                          |         |                   |                              |
| HUNGARY (GOVT) 5,25 %    |                          |         |                   |                              | KAZMUNAYGAS NATIONAL    |                          |         |                   |                              |
| 16.06.29                 | 7.474.000                | USD     | 7.407.621         | 0,72                         | 4,75 % 19.04.27         |                          |         |                   |                              |
| HUNGARY (GOVT) 5,5 %     |                          |         |                   |                              | 10.000.000              |                          |         |                   |                              |
| 16.06.34                 | 3.000.000                | USD     | 2.954.732         | 0,29                         | USD 9.760.811           |                          |         |                   |                              |
| HUNGARY (GOVT) 5,5 %     |                          |         |                   |                              | 0,95                    |                          |         |                   |                              |
| 26.03.36                 | 4.000.000                | USD     | 3.892.792         | 0,38                         | KAZMUNAYGAS NATIONAL    |                          |         |                   |                              |
| HUNGARY (GOVT) 6,125 %   |                          |         |                   |                              | 5,75 % 19.04.47         |                          |         |                   |                              |
| 22.05.28                 | 3.950.000                | USD     | 4.051.104         | 0,40                         | 1.400.000               |                          |         |                   |                              |
| HUNGARY (GOVT) 6,75 %    |                          |         |                   |                              | USD 1.220.744           |                          |         |                   |                              |
| 25.09.52                 | 8.000.000                | USD     | 8.599.788         | 0,85                         | 0,12                    |                          |         |                   |                              |
| MAGYAR EXPORT IMPORT     |                          |         |                   |                              | KAZMUNAYGAS NATIONAL    |                          |         |                   |                              |
| BANK 6,125 % 04.12.27    | 1.150.000                | USD     | 1.159.551         | 0,11                         | 6,375 % 24.10.48        |                          |         |                   |                              |
| MVM ENERGETIKA 6,5 %     |                          |         |                   |                              | 3.700.000               |                          |         |                   |                              |
| 13.03.31                 | 4.750.000                | USD     | 4.733.439         | 0,46                         | USD 3.475.404           |                          |         |                   |                              |
|                          |                          |         | <b>34.067.527</b> | <b>3,33</b>                  | <b>14.456.959</b>       |                          |         |                   |                              |
| <b>INDONESIEN</b>        |                          |         |                   |                              | <b>1,41</b>             |                          |         |                   |                              |
| INDONESIA (GOVT) 5,1 %   |                          |         |                   |                              | <b>KENIA</b>            |                          |         |                   |                              |
| 10/02/2054               | 7.000.000                | USD     | 6.787.316         | 0,66                         | KENYA (GOVT) 7 %        |                          |         |                   |                              |
| INDONESIA (GOVT) 5,25 %  |                          |         |                   |                              | 22.05.27                |                          |         |                   |                              |
| 17.01.42                 | 2.000.000                | USD     | 2.007.819         | 0,20                         | 3.810.000               |                          |         |                   |                              |
| INDONESIA (GOVT) 7,5 %   |                          |         |                   |                              | USD 3.723.174           |                          |         |                   |                              |
| 15.05.38                 | 94.000.000.000           | IDR     | 6.271.341         | 0,61                         | KENYA (GOVT) 7,25 %     |                          |         |                   |                              |
|                          |                          |         |                   |                              | 28.02.28                |                          |         |                   |                              |
|                          |                          |         |                   |                              | 2.700.000               |                          |         |                   |                              |
|                          |                          |         |                   |                              | USD 2.583.773           |                          |         |                   |                              |
|                          |                          |         |                   |                              | 0,25                    |                          |         |                   |                              |
|                          |                          |         |                   |                              | KENYA (GOVT) 9,75 %     |                          |         |                   |                              |
|                          |                          |         |                   |                              | 16.02.31                |                          |         |                   |                              |
|                          |                          |         |                   |                              | 3.300.000               |                          |         |                   |                              |
|                          |                          |         |                   |                              | USD 3.386.595           |                          |         |                   |                              |
|                          |                          |         |                   |                              | <b>9.693.542</b>        |                          |         |                   |                              |
|                          |                          |         |                   |                              | <b>0,95</b>             |                          |         |                   |                              |
|                          |                          |         |                   |                              | <b>LUXEMBURG</b>        |                          |         |                   |                              |
|                          |                          |         |                   |                              | ACU PETROLEO LUXEMBOURG |                          |         |                   |                              |
|                          |                          |         |                   |                              | 7,5 % 13.07.35          |                          |         |                   |                              |
|                          |                          |         |                   |                              | 6.000.000               |                          |         |                   |                              |
|                          |                          |         |                   |                              | USD 5.663.479           |                          |         |                   |                              |
|                          |                          |         |                   |                              | 0,56                    |                          |         |                   |                              |
|                          |                          |         |                   |                              | AEGEA FINANCE 9 %       |                          |         |                   |                              |
|                          |                          |         |                   |                              | 20.01.31                |                          |         |                   |                              |
|                          |                          |         |                   |                              | 2.380.000               |                          |         |                   |                              |
|                          |                          |         |                   |                              | USD 2.522.344           |                          |         |                   |                              |
|                          |                          |         |                   |                              | 0,25                    |                          |         |                   |                              |
|                          |                          |         |                   |                              | GREENSAIF PIPELINES     |                          |         |                   |                              |
|                          |                          |         |                   |                              | BIDCO 6,129 % 23.02.38  |                          |         |                   |                              |
|                          |                          |         |                   |                              | 1.243.000               |                          |         |                   |                              |
|                          |                          |         |                   |                              | USD 1.264.834           |                          |         |                   |                              |
|                          |                          |         |                   |                              | 0,12                    |                          |         |                   |                              |
|                          |                          |         |                   |                              | GREENSAIF PIPELINES     |                          |         |                   |                              |
|                          |                          |         |                   |                              | BIDCO 6,51 % 23.02.42   |                          |         |                   |                              |
|                          |                          |         |                   |                              | 2.400.000               |                          |         |                   |                              |
|                          |                          |         |                   |                              | USD 2.498.322           |                          |         |                   |                              |
|                          |                          |         |                   |                              | 0,24                    |                          |         |                   |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Emerging Markets Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung                                       | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|--|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|
| MHP LUX 6,95 % 03.04.2026                              | 2.340.000                | USD     | 1.982.462         | 0,19                         | <b>OMAN</b>  |                          |         |                   |                              |
| RAIZEN FUELS FINANCE<br>6,95 % 05.03.54                | 2.000.000                | USD     | 2.064.344         | 0,20                         | LAMAR FUNDING 3,958 %<br>07/05/2025                | 8.563.000                | USD     | 8.360.427         | 0,82                         |
|  |                          |         | <b>15.995.785</b> | <b>1,56</b>                  | OMAN (GOVT) 5,625 %<br>17.01.28                    | 5.000.000                | USD     | 5.032.097         | 0,49                         |
| <b>MEXIKO</b>  |                          |         |                   |                              | OMAN (GOVT) 6 % 01.08.2029                         | 2.800.000                | USD     | 2.868.532         | 0,28                         |
| BBVA BANCOMER 8,45 % VRN<br>29.06.38                   | 4.000.000                | USD     | 4.225.341         | 0,41                         | OMAN (GOVT) 6,75 %<br>17.01.48                     | 2.000.000                | USD     | 2.050.160         | 0,20                         |
| COMISION FEDERAL DE<br>ELECTRICIDA 4,688 %<br>15.05.29 | 2.895.000                | USD     | 2.725.543         | 0,27                         | OMAN (GOVT) 7 % 25.01.51                           | 2.050.000                | USD     | 2.161.961         | 0,21                         |
| MEXICO (GOVT) 5,4 %<br>09/02/2028                      | 3.000.000                | USD     | 3.022.218         | 0,30                         |  |                          |         | <b>20.473.177</b> | <b>2,00</b>                  |
| MEXICO (GOVT) 6,05 %<br>11/01/2040                     | 2.000.000                | USD     | 1.986.385         | 0,19                         | <b>PARAGUAY</b>                                    |                          |         |                   |                              |
| MEXICO (GOVT) 6,4 %<br>07/05/2054                      | 5.500.000                | USD     | 5.502.402         | 0,54                         | PARAGUAY (GOVT) 5,85 %<br>21.08.33                 | 4.000.000                | USD     | 4.014.730         | 0,39                         |
| MEXICO (GOVT) 7,5 %<br>03/06/2027                      | 520.000                  | MXN     | 2.962.470         | 0,29                         |  |                          |         | <b>4.014.730</b>  | <b>0,39</b>                  |
| MEXICO (GOVT) 8,5 %<br>18.11.38                        | 214.000                  | MXN     | 1.201.868         | 0,12                         | <b>PERU</b>  |                          |         |                   |                              |
| MEXICO CITY AIRPORT<br>TRUST 4,25 % 31.10.26           | 8.032.000                | USD     | 7.772.890         | 0,76                         | PETROLEOS DEL PERU<br>4,75 % 19.06.32              | 6.000.000                | USD     | 4.720.458         | 0,46                         |
| MEXICO CITY AIRPORT<br>TRUST 5,5 % 31.07.47            | 5.400.000                | USD     | 4.563.764         | 0,45                         | PETROLEOS DEL PERU<br>5,625 % 19.06.47             | 8.850.000                | USD     | 5.918.672         | 0,58                         |
| PETROLEOS MEXICANOS<br>6,5 % 13.03.27                  | 11.250.000               | USD     | 10.607.838        | 1,03                         |  |                          |         | <b>10.639.130</b> | <b>1,04</b>                  |
| PETROLEOS MEXICANOS<br>8,75 % 02.06.29                 | 5.864.489                | USD     | 5.722.763         | 0,56                         | <b>POLEN</b>                                       |                          |         |                   |                              |
| TRUST FIBRA 7,375 %<br>13.02.34                        | 4.000.000                | USD     | 3.995.133         | 0,39                         | BANK GOSPODARSTWA<br>KRAJOWEGO 5,375 %<br>22.05.33 | 3.030.000                | USD     | 3.022.246         | 0,30                         |
|  |                          |         | <b>54.288.615</b> | <b>5,31</b>                  | BANK GOSPODARSTWA<br>KRAJOWEGO 6,25 %<br>31.10.28  | 1.800.000                | USD     | 1.878.501         | 0,18                         |
| <b>MAROKKO</b>   |                          |         |                   |                              | POLAND (GOVT) 4,875 %<br>04/10/2033                | 2.200.000                | USD     | 2.172.345         | 0,21                         |
| OFFICE CHERIFIEN DES<br>PHOSPHATES 5,625 % 25.04.2024  | 2.000.000                | USD     | 2.001.568         | 0,20                         | POLAND (GOVT) 5,125 %<br>18.09.34                  | 1.500.000                | USD     | 1.497.304         | 0,15                         |
|  |                          |         | <b>2.001.568</b>  | <b>0,20</b>                  | POLAND (GOVT) 5,5 %<br>16.11.27                    | 3.500.000                | USD     | 3.580.966         | 0,35                         |
| <b>NIEDERLANDE</b>                                     |                          |         |                   |                              | POLAND (GOVT) 5,5 %<br>04/04/2053                  | 2.273.000                | USD     | 2.271.578         | 0,22                         |
| PETROBRAS GLOBAL<br>FINANCE 8,75 % 23.05.26            | 3.000.000                | USD     | 3.186.004         | 0,31                         | POLAND (GOVT) 5,75 %<br>16.11.32                   | 1.000.000                | USD     | 1.048.521         | 0,10                         |
|  |                          |         | <b>3.186.004</b>  | <b>0,31</b>                  |  |                          |         | <b>15.471.461</b> | <b>1,51</b>                  |
| <b>NIGERIA</b>   |                          |         |                   |                              | <b>KATAR</b>                                       |                          |         |                   |                              |
| NIGERIA (GOVT) 6,5 %<br>28.11.27                       | 10.000.000               | USD     | 9.430.978         | 0,92                         | QATAR (GOVT) 4,4 %<br>16.04.50                     | 3.667.000                | USD     | 3.249.508         | 0,32                         |
| NIGERIA (GOVT) 7,143 %<br>23.02.30                     | 5.530.000                | USD     | 5.039.782         | 0,49                         | QATAR (GOVT) 4,625 %<br>02/06/2046                 | 2.800.000                | USD     | 2.579.651         | 0,25                         |
| NIGERIA (GOVT) 7,625 %<br>28.11.47                     | 11.850.000               | USD     | 9.240.553         | 0,90                         | QATAR (GOVT) 4,817 %<br>14.03.49                   | 2.000.000                | USD     | 1.878.104         | 0,18                         |
| NIGERIA (GOVT) 7,696 %<br>23.02.38                     | 8.610.000                | USD     | 7.116.009         | 0,70                         | QATAR (GOVT) 5,103 %<br>23.04.48                   | 7.800.000                | USD     | 7.608.032         | 0,74                         |
| NIGERIA (GOVT) 8,25 %<br>28.09.51                      | 3.870.000                | USD     | 3.177.188         | 0,31                         | QATAR PETROLEUM 3,3 %<br>12/07/2051                | 1.000.000                | USD     | 708.250           | 0,07                         |
| NIGERIA (GOVT) 8,375 %<br>24.03.29                     | 4.000.000                | USD     | 3.912.218         | 0,38                         | QNB FINANCE 1,375 %<br>26.01.26                    | 1.500.000                | USD     | 1.398.805         | 0,14                         |
|  |                          |         | <b>37.916.728</b> | <b>3,70</b>                  |  |                          |         | <b>17.422.350</b> | <b>1,70</b>                  |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Emerging Markets Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung               | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung                        | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|----------------------------|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|-------------------------------------|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|
| <b>RUMÄNIEN</b>            |                          |         |                   |                              | SRI LANKA (GOVT) 7,55 %             |                          |         |                   |                              |
| ROMANIA (GOVT) 3 %         |                          |         |                   |                              | 28.03.30                            | 7.300.000                | USD     | 4.306.390         | 0,42                         |
| 27.02.27                   | 6.000.000                | USD     | 5.608.697         | 0,55                         |                                     |                          |         | <b>13.139.830</b> | <b>1,28</b>                  |
| ROMANIA (GOVT) 5,25 %      |                          |         |                   |                              | <b>TRINIDAD &amp; TOBAGO</b>        |                          |         |                   |                              |
| 25.11.27                   | 5.010.000                | USD     | 4.946.440         | 0,48                         | TRINIDAD TOBAGO (GOVT)              |                          |         |                   |                              |
| ROMANIA (GOVT) 6,375 %     |                          |         |                   |                              | 4,5 % 26.06.30                      | 945.000                  | USD     | 887.642           | 0,09                         |
| 30.01.34                   | 4.000.000                | USD     | 4.064.346         | 0,40                         | TRINIDAD & TOBAGO                   |                          |         |                   |                              |
|                            |                          |         | <b>14.619.483</b> | <b>1,43</b>                  | (GOVT) 5,95 % 14.01.2031            | 13.705.000               | USD     | 13.774.333        | 1,34                         |
|                            |                          |         |                   |                              |                                     |                          |         | <b>14.661.975</b> | <b>1,43</b>                  |
| <b>SAUDI-ARABIEN</b>       |                          |         |                   |                              | <b>TÜRKEI</b>                       |                          |         |                   |                              |
| GACI FIRST INVESTMENT      |                          |         |                   |                              | TURKEY (GOVT) 5,75 %                |                          |         |                   |                              |
| 4,75 % 14.02.30            | 9.430.000                | USD     | 9.250.004         | 0,90                         | 11/05/2047                          | 8.850.000                | USD     | 6.745.095         | 0,66                         |
| GACI FIRST INVESTMENT      |                          |         |                   |                              | TURKEY (GOVT) 6,375 %               |                          |         |                   |                              |
| 5,25 % 29.01.34            | 3.000.000                | USD     | 2.973.027         | 0,29                         | 14.10.25                            | 2.000.000                | USD     | 2.015.507         | 0,20                         |
| GACI FIRST INVESTMENT      |                          |         |                   |                              | TURKEY (GOVT) 9,125 %               |                          |         |                   |                              |
| 5,375 % 29.01.54           | 4.000.000                | USD     | 3.566.027         | 0,35                         | 13.07.30                            | 3.290.000                | USD     | 3.569.982         | 0,35                         |
| KSA SUKUK 4,27 %           |                          |         |                   |                              | TURKEY (GOVT) 9,375 %               |                          |         |                   |                              |
| 22.05.29                   | 2.000.000                | USD     | 1.954.463         | 0,19                         | 14.03.29                            | 5.000.000                | USD     | 5.450.082         | 0,53                         |
| SAUDI ARABIA (GOVT) 4,5 %  |                          |         |                   |                              | TURKEY (GOVT) 9,375 %               |                          |         |                   |                              |
| 17.04.30                   | 7.950.000                | USD     | 7.802.474         | 0,76                         | 19.01.33                            | 3.510.000                | USD     | 3.912.463         | 0,38                         |
| SAUDI ARABIA (GOVT) 4,75 % |                          |         |                   |                              | TURKIYE VARLIK FONU                 |                          |         |                   |                              |
| 16.01.30                   | 3.100.000                | USD     | 3.069.772         | 0,30                         | YONETIMI 8,25 % 14.02.2029          | 6.500.000                | USD     | 6.633.026         | 0,65                         |
| SAUDI ARABIA (GOVT) 5 %    |                          |         |                   |                              |                                     |                          |         | <b>28.326.155</b> | <b>2,77</b>                  |
| 17.04.49                   | 2.000.000                | USD     | 1.824.609         | 0,18                         | <b>UKRAINE</b>                      |                          |         |                   |                              |
| SAUDI ARABIA (GOVT) 5,25 % |                          |         |                   |                              | UKRAINE (GOVT) 0 % VRN              |                          |         |                   |                              |
| 16.01.50                   | 6.630.000                | USD     | 6.269.519         | 0,61                         | 31.05.40                            | 6.800.000                | USD     | 3.790.740         | 0,37                         |
| SAUDI ARABIA (GOVT) 5,75 % |                          |         |                   |                              | UKRAINE (GOVT) 7,375 %              |                          |         |                   |                              |
| 16.01.54                   | 9.700.000                | USD     | 9.618.357         | 0,94                         | 25.09.32                            | 2.800.000                | USD     | 826.313           | 0,08                         |
| SAUDI ELECTRICITY SUKUK    |                          |         |                   |                              | UKRAINE (GOVT) 7,75 %               |                          |         |                   |                              |
| PROGRAM 5,194 % 13.02.2034 | 2.000.000                | USD     | 2.009.750         | 0,20                         | 01/09/2024                          | 6.500.000                | USD     | 2.455.322         | 0,24                         |
| SUCI SECOND INVESTMENT     |                          |         |                   |                              | UKRAINE (GOVT) 7,75 %               |                          |         |                   |                              |
| 6 % 25.10.28               | 3.140.000                | USD     | 3.250.608         | 0,32                         | 01/09/2027                          | 7.400.000                | USD     | 2.453.875         | 0,24                         |
|                            |                          |         | <b>51.588.610</b> | <b>5,04</b>                  |                                     |                          |         | <b>9.526.250</b>  | <b>0,93</b>                  |
| <b>SENEGAL</b>             |                          |         |                   |                              | <b>VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE</b> |                          |         |                   |                              |
| SENEGAL (GOVT) 6,25 %      |                          |         |                   |                              | ABU DHABI (GOVT) 3,125 %            |                          |         |                   |                              |
| 23.05.33                   | 2.000.000                | USD     | 1.709.713         | 0,17                         | 16.04.30                            | 1.350.000                | USD     | 1.244.887         | 0,12                         |
|                            |                          |         | <b>1.709.713</b>  | <b>0,17</b>                  | ABU DHABI (GOVT) 4,125 %            |                          |         |                   |                              |
| <b>SÜDAFRIKA</b>           |                          |         |                   |                              | 11/10/2047                          | 9.000.000                | USD     | 7.612.150         | 0,74                         |
| ESKOM HOLDINGS 4,314 %     |                          |         |                   |                              | ABU DHABI COMMERCIAL                |                          |         |                   |                              |
| 23.07.27                   | 2.000.000                | USD     | 1.840.921         | 0,18                         | BANK 4,5 % 14.09.27                 | 3.000.000                | USD     | 2.944.021         | 0,29                         |
| SOUTH AFRICA (GOVT)        |                          |         |                   |                              | DP WORLD 5,625 %                    |                          |         |                   |                              |
| 5,875 % 22.06.30           | 2.000.000                | USD     | 1.856.597         | 0,18                         | 25.09.48                            | 1.750.000                | USD     | 1.680.500         | 0,16                         |
| SOUTH AFRICA (GOVT)        |                          |         |                   |                              | TAQA ABU DHABI NATIONAL             |                          |         |                   |                              |
| 6,25 % 08.03.41            | 4.000.000                | USD     | 3.309.875         | 0,32                         | ENERGY 6,5 % 27.10.36               | 1.500.000                | USD     | 1.700.904         | 0,17                         |
|                            |                          |         | <b>7.007.393</b>  | <b>0,68</b>                  |                                     |                          |         | <b>15.182.462</b> | <b>1,48</b>                  |
| <b>SRI LANKA</b>           |                          |         |                   |                              | <b>USA</b>                          |                          |         |                   |                              |
| SRI LANKA (GOVT) 6,75 %    |                          |         |                   |                              | BIMBO BAKERIES 6,4 %                |                          |         |                   |                              |
| 18.04.28                   | 1.400.000                | USD     | 830.347           | 0,08                         | 15.01.34                            | 4.000.000                | USD     | 4.298.787         | 0,42                         |
| SRI LANKA (GOVT) 6,85 %    |                          |         |                   |                              | KOSMOS ENERGY 7,125 %               |                          |         |                   |                              |
| 14.03.2024**               | 11.982.000               | USD     | 6.620.056         | 0,64                         | 04/04/2026                          | 3.100.000                | USD     | 3.050.830         | 0,30                         |
| SRI LANKA (GOVT) 6,85 %    |                          |         |                   |                              | SASOL FINANCING 4,375 %             |                          |         |                   |                              |
| 03/11/2025                 | 2.300.000                | USD     | 1.383.037         | 0,14                         | 18.09.26                            | 2.000.000                | USD     | 1.886.330         | 0,18                         |

\*\* Der Vermögenswert, der am 14. März 2024 fällig war, ist notleidend. Zur Bewertung wurde der letzte verfügbare Preis auf dem Markt herangezogen.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Emerging Markets Bond (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--------------------------|---------|--------------------|------------------------------|---|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|
| SASOL FINANCING 8,75 %<br>03/05/2029   | 1.680.000                | USD     | 1.711.221          | 0,17                         | CORP NACIONAL DEL COBRE<br>DE CHILE 4,5 % 01.08.47              | 3.400.000                | USD     | 2.688.208         | 0,26                         |
|  |                          |         | <b>10.947.168</b>  | <b>1,07</b>                  | EMPRESA NACIONAL DEL<br>PETROLEO 3,45 % 16.09.31                | 3.550.000                | USD     | 3.034.314         | 0,30                         |
| <b>URUGUAY</b>   |                          |         |                    |                              | EMPRESA NACIONAL DEL<br>PETROLEO 3,75 % 05.08.2026              | 7.286.000                | USD     | 6.967.344         | 0,68                         |
| URUGUAY (GOVT) 4,5 %<br>14.08.24   | 38.236                   | USD     | 12.712             | 0,00                         | EMPRESA NACIONAL DEL<br>PETROLEO 5,25 % 06.11.29                | 3.400.000                | USD     | 3.329.056         | 0,33                         |
| URUGUAY (GOVT) 5,75 %<br>28.10.34  | 11.000.000               | USD     | 11.626.997         | 1,14                         | INVERSIONES CMPC 6,125 %<br>26.02.34                            | 1.875.000                | USD     | 1.906.811         | 0,19                         |
| URUGUAY (GOVT) 7,625 %<br>21.03.36   | 79.900                   | USD     | 96.749             | 0,01                         |   |                          |         | <b>23.306.856</b> | <b>2,29</b>                  |
|  |                          |         | <b>11.736.458</b>  | <b>1,15</b>                  | <b>KOLUMBIEN</b>  |                          |         |                   |                              |
| <b>VENEZUELA</b>   |                          |         |                    |                              | ECOPETROL 5,375 %<br>26.06.26                                   | 5.935.000                | USD     | 5.842.082         | 0,57                         |
| VENEZUELA (GOVT) 9,375 %<br>13.01.34   | 5.000.000                | USD     | 859.880            | 0,08                         |   |                          |         | <b>5.842.082</b>  | <b>0,57</b>                  |
|  |                          |         | <b>859.880</b>     | <b>0,08</b>                  | <b>COSTA RICA</b>   |                          |         |                   |                              |
| <b>SAMBIA</b>  |                          |         |                    |                              | COSTA RICA (GOVT)<br>4,375 % 30.04.25                           | 5.000.000                | USD     | 4.941.501         | 0,48                         |
| ZAMBIA (GOVT) 8,97 %<br>30.07.27   | 1.400.000                | USD     | 1.033.809          | 0,10                         | COSTA RICA (GOVT)<br>6,125 % 19.02.31                           | 12.000.000               | USD     | 12.171.030        | 1,19                         |
|  |                          |         | <b>1.033.809</b>   | <b>0,10</b>                  | COSTA RICA (GOVT)<br>7,158 % 12.03.45                           | 1.800.000                | USD     | 1.887.782         | 0,18                         |
| <b>SUMME ANLEIHEN</b>  |                          |         | <b>657.836.735</b> | <b>64,28</b>                 | COSTA RICA (GOVT) 7,3 %<br>13.11.54                             | 6.590.000                | USD     | 7.014.069         | 0,69                         |
| <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN<br/>BÖRSE NOTIERTEN WERTPAPIERE</b>              |                          |         | <b>657.836.735</b> | <b>64,28</b>                 | INSTITUTO COSTARRICENSE<br>DE ELECTRICIDAD 6,75 %<br>07/10/2031 | 1.919.000                | USD     | 1.939.572         | 0,19                         |
| <b>WERTPAPIERE</b>   |                          |         |                    |                              |   |                          |         | <b>27.953.954</b> | <b>2,73</b>                  |
| <b>AN EINEM ANDEREM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE, ÜBERTRAGBARE<br/>WERTPAPIERE</b> |                          |         |                    |                              | <b>DOMINIKANISCHE REPUBLIK</b>                                  |                          |         |                   |                              |
| <b>ANLEIHEN</b>  |                          |         |                    |                              | DOMINIC (GOVT) 5,3 %<br>21.01.41                                | 4.200.000                | USD     | 3.576.263         | 0,35                         |
| <b>ARGENTINIEN</b>   |                          |         |                    |                              | DOMINIC (GOVT) 5,5 %<br>22.02.29                                | 11.626.000               | USD     | 11.308.377        | 1,10                         |
| ARGENTINA (GOVT) 0,125 %<br>09/07/2030   | 18.405.566               | USD     | 9.571.964          | 0,94                         | DOMINIC (GOVT) 5,875 %<br>30.01.60                              | 4.000.000                | USD     | 3.409.069         | 0,33                         |
| ARGENTINA (GOVT) 0,125 %<br>09/01/2038   | 4.488.000                | USD     | 2.090.600          | 0,20                         | DOMINIC (GOVT) 5,95 %<br>25.01.27                               | 1.300.000                | USD     | 1.297.290         | 0,13                         |
| ARGENTINA (GOVT) 0,125 %<br>09/07/2041   | 13.787.649               | USD     | 5.593.640          | 0,55                         | DOMINIC (GOVT) 6 %<br>22.02.33                                  | 3.130.000                | USD     | 3.048.253         | 0,30                         |
|  |                          |         | <b>17.256.204</b>  | <b>1,69</b>                  | DOMINIC (GOVT) 6,4 %<br>05/06/2049                              | 6.650.000                | USD     | 6.260.698         | 0,61                         |
| <b>BRASILIEN</b>   |                          |         |                    |                              | DOMINIC (GOVT) 6,5 %<br>15.02.48                                | 4.500.000                | USD     | 4.286.916         | 0,42                         |
| BANCO DO BRASIL 6 %<br>18.03.31  | 3.725.000                | USD     | 3.733.922          | 0,36                         |   |                          |         | <b>33.186.866</b> | <b>3,24</b>                  |
| BRAZIL (GOVT) 4,75 %<br>14.01.50   | 2.000.000                | USD     | 1.503.760          | 0,15                         | <b>ECUADOR</b>  |                          |         |                   |                              |
| BRAZILIAN (GOVT) 6,25 %<br>18.03.31  | 5.000.000                | USD     | 5.106.152          | 0,50                         | ECUADOR (GOVT) 0,5 %<br>31.07.30                                | 4.709.000                | USD     | 3.204.361         | 0,31                         |
| MC BRAZIL DOWNSTREAM<br>TRADING 7,25 % 30.06.2031                                | 4.600.000                | USD     | 3.976.354          | 0,39                         | ECUADOR (GOVT) 0,5 %<br>31.07.35                                | 17.259.535               | USD     | 9.108.837         | 0,89                         |
| SAMARCO MINERACAO 9,5 %<br>30.06.31  | 5.460.000                | USD     | 4.940.075          | 0,48                         | ECUADOR (GOVT) 0,5 %<br>31.07.40                                | 7.172.373                | USD     | 3.494.834         | 0,34                         |
|  |                          |         | <b>19.260.263</b>  | <b>1,88</b>                  |   |                          |         | <b>15.808.032</b> | <b>1,54</b>                  |
| <b>CHILE</b>   |                          |         |                    |                              |   |                          |         |                   |                              |
| CHILE (GOVT) 4,34 %<br>07/03/2042  | 6.150.000                | USD     | 5.381.123          | 0,53                         |   |                          |         |                   |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Emerging Markets Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|--|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|
| <b>ÄGYPTEN</b>  |                          |         |                   |                              | <b>MEXIKO</b>  |                          |         |                   |                              |
| EGYPT (GOVT) 7,5 %<br>31.01.27                        | 5.400.000                | USD     | 5.212.200         | 0,51                         | BANCO MERCANTIL DEL NORTE<br>SAGRAN 5,875 % VRN PERP | 5.000.000                | USD     | 4.785.668         | 0,47                         |
|   |                          |         | <b>5.212.200</b>  | <b>0,51</b>                  | BBVA BANCOMER TEXAS<br>5,875 % VRN 13.09.34          | 2.500.000                | USD     | 2.366.167         | 0,23                         |
| <b>EL SALVADOR</b>                                    |                          |         |                   |                              | MEXICO (GOVT) 4,5 %<br>22.04.29                      |                          |         |                   |                              |
| EL SALVADOR (GOVT)<br>6,375 % 18.01.27                | 1.100.000                | USD     | 960.401           | 0,09                         | PETROLEOS MEXICANOS<br>6,75 % 21.09.47               | 5.000.000                | USD     | 3.326.890         | 0,33                         |
| EL SALVADOR (GOVT)<br>7,625 % 01.02.41                | 4.700.000                | USD     | 3.457.777         | 0,34                         | PETROLEOS MEXICANOS<br>6,95 % 28.01.60               | 7.850.000                | USD     | 5.190.820         | 0,51                         |
|   |                          |         | <b>4.418.178</b>  | <b>0,43</b>                  | PETROLEOS MEXICANOS<br>7,69 % 23.01.50               | 20.939.000               | USD     | 15.038.518        | 1,47                         |
| <b>HONDURAS</b>                                       |                          |         |                   |                              | <b>NIEDERLANDE</b>                                   |                          |         |                   |                              |
| HONDURAS (GOVT) 6,25 %<br>19.01.27                    | 1.500.000                | USD     | 1.452.917         | 0,14                         | PROSUS 3,257 % 19.01.27                              | 4.000.000                | USD     | 3.711.833         | 0,36                         |
|   |                          |         | <b>1.452.917</b>  | <b>0,14</b>                  |  |                          |         | <b>3.711.833</b>  | <b>0,36</b>                  |
| <b>INDONESIEN</b>                                     |                          |         |                   |                              | <b>NIGERIA</b>                                       |                          |         |                   |                              |
| INDONESIA (GOVT) 3,55 %<br>09/06/2051                 | 2.000.000                | USD     | 1.488.127         | 0,15                         | NIGERIA (GOVT) 7,875 %<br>16.02.32                   | 3.200.000                | USD     | 2.905.821         | 0,28                         |
| INDONESIA (GOVT) 4,75 %<br>11/02/2029                 | 2.000.000                | USD     | 1.990.112         | 0,19                         |  |                          |         | <b>2.905.821</b>  | <b>0,28</b>                  |
|   |                          |         | <b>3.478.239</b>  | <b>0,34</b>                  | <b>PAKISTAN</b>                                      |                          |         |                   |                              |
| <b>Elfenbeinküste</b>                                 |                          |         |                   |                              | PAKISTAN (GOVT) 6,875 %<br>05/12/2027                |                          |         |                   |                              |
| IVORY COAST (GOVT)<br>5,375 % 23.07.24                | 1.309.000                | USD     | 1.302.255         | 0,13                         | PAKISTAN (GOVT) 7,375 %<br>08/04/2031                | 3.600.000                | USD     | 3.085.738         | 0,30                         |
|   |                          |         | <b>1.302.255</b>  | <b>0,13</b>                  | PAKISTAN (GOVT) 8,25 %<br>30.09.25                   | 3.430.000                | USD     | 3.237.407         | 0,32                         |
| <b>JAMAICA</b>  |                          |         |                   |                              | PAKISTAN (GOVT) 8,875 %<br>08/04/2051                |                          |         |                   |                              |
| JAMAICA (GOVT) 6,75 %<br>28.04.28                     | 2.300.000                | USD     | 2.374.720         | 0,23                         |  | 3.200.000                | USD     | 2.425.519         | 0,24                         |
| JAMAICA (GOVT) 7,875 %<br>28.07.45                    | 1.400.000                | USD     | 1.650.594         | 0,16                         |  |                          |         | <b>10.210.326</b> | <b>1,00</b>                  |
|   |                          |         | <b>4.025.314</b>  | <b>0,39</b>                  | <b>PANAMA</b>  |                          |         |                   |                              |
| <b>JERSEY</b>   |                          |         |                   |                              | PANAMA (GOVT) 8 %<br>01/03/2038                      |                          |         |                   |                              |
| GALAXY PIPELINE ASSETS<br>2,625 % 31.03.36            | 5.500.000                | USD     | 4.490.375         | 0,44                         |  | 3.000.000                | USD     | 3.195.230         | 0,31                         |
|   |                          |         | <b>4.490.375</b>  | <b>0,44</b>                  |  |                          |         | <b>3.195.230</b>  | <b>0,31</b>                  |
| <b>LIBANON</b>  |                          |         |                   |                              | <b>PARAGUAY</b>                                      |                          |         |                   |                              |
| LEBANON (GOVT) 6,85 %<br>23.03.27                     | 15.000.000               | USD     | 1.017.620         | 0,10                         | BANCO CONTINENTAL 2,75 %<br>10/12/2025               | 2.831.000                | USD     | 2.672.059         | 0,26                         |
|   |                          |         | <b>1.017.620</b>  | <b>0,10</b>                  | PARAGUAY (GOVT) 5,4 %<br>30.03.50                    | 6.954.000                | USD     | 6.135.147         | 0,60                         |
| <b>LUXEMBURG</b>                                      |                          |         |                   |                              | <b>PERU</b>  |                          |         |                   |                              |
| AEGEA FINANCE 6,75 %<br>20.05.29                      | 3.000.000                | USD     | 2.935.325         | 0,29                         | BANCO INTERNACIONAL DEL<br>PERU 3,25 % 04.10.26      | 2.100.000                | USD     | 1.982.871         | 0,19                         |
| CHILE ELECTRICITY 6,01 %<br>20.01.33                  | 3.820.000                | USD     | 3.876.740         | 0,38                         | FONDO MIVIVIENDA 4,625 %<br>12/04/2027               | 3.000.000                | USD     | 2.923.278         | 0,29                         |
| MILLICOM INTERNATIONAL<br>CELLULAR 7,375 % 02.04.2032 | 4.161.000                | USD     | 4.168.500         | 0,40                         | PERU (GOVT) 3 % 15.01.2034                           | 6.300.000                | USD     | 5.169.510         | 0,51                         |
| RAIZEN FUELS FINANCE<br>6,45 % 05.03.34               | 1.850.000                | USD     | 1.899.564         | 0,19                         | PERU (GOVT) 3,3 %<br>11/03/2041                      | 5.750.000                | USD     | 4.326.545         | 0,42                         |
|   |                          |         | <b>12.880.129</b> | <b>1,26</b>                  |  |                          |         | <b>14.402.204</b> | <b>1,41</b>                  |
| <b>MALAYSIA</b>                                       |                          |         |                   |                              |  |                          |         |                   |                              |
| PETRONAS CAPITAL 3,5 %<br>18.03.25                    | 1.500.000                | USD     | 1.471.944         | 0,14                         |  |                          |         |                   |                              |
|   |                          |         | <b>1.471.944</b>  | <b>0,14</b>                  |  |                          |         |                   |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Emerging Markets Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung                                   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert             | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--------------------------|---------|--------------------|------------------------------|--|--------------------------|---------|----------------------|------------------------------|
| <b>POLEN</b>   |                          |         |                    |                              | <b>VENEZUELA</b>                               |                          |         |                      |                              |
| POLAND (GOVT) 5,5 %<br>18.03.54  | 3.900.000                | USD     | 3.883.926          | 0,38                         | PETROLEOS DE VENEZUELA<br>6 % 15.11.26         | 5.000.000                | USD     | 469.261              | 0,05                         |
|  |                          |         | <b>3.883.926</b>   | <b>0,38</b>                  | VENEZUELA (GOVT) 9,25 %<br>07/05/2028          | 26.000.000               | USD     | 4.220.110            | 0,40                         |
| <b>SÜDAFRIKA</b>   |                          |         |                    |                              | <b>SUMME ANLEIHEN</b>                          |                          |         |                      |                              |
| SOUTH AFRICA (GOVT)<br>4,3 % 12.10.28  | 9.000.000                | USD     | 8.095.084          | 0,79                         |  |                          |         | <b>4.689.371</b>     | <b>0,45</b>                  |
|  |                          |         | <b>8.095.084</b>   | <b>0,79</b>                  |  |                          |         | <b>12.434.169</b>    | <b>1,21</b>                  |
| <b>USA</b>   |                          |         |                    |                              | <b>SUMME SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |                          |         |                      |                              |
| KOSMOS ENERGY 7,75 %<br>01/05/2027   | 2.400.000                | USD     | 2.372.431          | 0,23                         |  |                          |         | <b>12.434.169</b>    | <b>1,21</b>                  |
|  |                          |         | <b>2.372.431</b>   | <b>0,23</b>                  |  |                          |         | <b>1.013.047.468</b> | <b>98,98</b>                 |
| <b>URUGUAY</b>   |                          |         |                    |                              | <b>SUMME WERTPAPIERANLAGEN</b>                 |                          |         |                      |                              |
| URUGUAY (GOVT) 4,375 %<br>23.01.31   | 6.800.000                | USD     | 6.666.771          | 0,65                         |  |                          |         | <b>10.457.538</b>    | <b>1,02</b>                  |
| URUGUAY (GOVT) 4,975 %<br>20.04.55   | 5.000.000                | USD     | 4.701.742          | 0,46                         |  |                          |         | <b>1.023.505.006</b> | <b>100,00</b>                |
| URUGUAY (GOVT) 5,1 %<br>18.06.50   | 9.000.000                | USD     | 8.721.098          | 0,85                         |  |                          |         |                      |                              |
|  |                          |         | <b>20.089.611</b>  | <b>1,96</b>                  |  |                          |         |                      |                              |
| <b>SAMBIA</b>  |                          |         |                    |                              | <b>SUMME SONSTIGES NETTOVERMÖGEN</b>           |                          |         |                      |                              |
| ZAMBIA (GOVT) 5,375 %<br>20.09.2022***   | 1.574.000                | USD     | 841.201            | 0,08                         |  |                          |         |                      |                              |
| ZAMBIA (GOVT) 8,5 %<br>14.04.24  | 6.900.000                | USD     | 5.107.991          | 0,50                         |  |                          |         |                      |                              |
|  |                          |         | <b>5.949.192</b>   | <b>0,58</b>                  |  |                          |         |                      |                              |
| <b>SUMME ANLEIHEN</b>  |                          |         |                    |                              | <b>GESAMTNETTOVERMÖGEN</b>                     |                          |         |                      |                              |
|  |                          |         | <b>300.375.718</b> | <b>29,35</b>                 |  |                          |         |                      |                              |
| <b>SUMME DER AN EINER GEREGELTEN<br/>MARKT GEHANDELTEN ÜBERTRAGBAREN WERTPAPIERE</b> |                          |         |                    |                              |  |                          |         |                      |                              |
|  |                          |         | <b>300.375.718</b> | <b>29,35</b>                 |  |                          |         |                      |                              |
| <b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>   |                          |         |                    |                              |  |                          |         |                      |                              |
| <b>IRLAND</b>  |                          |         |                    |                              |  |                          |         |                      |                              |
| HSBC GLOBAL LIQUIDITY<br>FUND  | 42.400.846               | USD     | 42.400.846         | 4,14                         |  |                          |         |                      |                              |
|  |                          |         | <b>42.400.846</b>  | <b>4,14</b>                  |  |                          |         |                      |                              |
| <b>SUMME ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>                                       |                          |         |                    |                              |  |                          |         |                      |                              |
|  |                          |         | <b>42.400.846</b>  | <b>4,14</b>                  |  |                          |         |                      |                              |
| <b>SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>   |                          |         |                    |                              |  |                          |         |                      |                              |
| <b>ANLEIHEN</b>  |                          |         |                    |                              |  |                          |         |                      |                              |
| <b>CHILE</b>   |                          |         |                    |                              |  |                          |         |                      |                              |
| CORP NACIONAL DEL COBRE<br>DE CHILE 3 % 30.09.29                                     | 5.142.000                | USD     | 4.555.242          | 0,45                         |  |                          |         |                      |                              |
|  |                          |         | <b>4.555.242</b>   | <b>0,45</b>                  |  |                          |         |                      |                              |
| <b>GUATEMALA</b>   |                          |         |                    |                              |  |                          |         |                      |                              |
| GUATEMALA (GOVT) 7,05 %<br>04/10/2032  | 3.000.000                | USD     | 3.189.556          | 0,31                         |  |                          |         |                      |                              |
|  |                          |         | <b>3.189.556</b>   | <b>0,31</b>                  |  |                          |         |                      |                              |

\*\*\* Der Vermögenswert, der am 20. September 2022 fällig war, ist notleidend. Zur Bewertung wurde der letzte verfügbare Preis auf dem Markt herangezogen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Emerging Markets Corporate Sustainable Bond  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung  | Nennwert  | Währung | Kurswert         | % des Nettovermögens | Beschreibung                                      | Nennwert  | Währung | Kurswert          | % des Nettovermögens |           |      |
|---|-----------|---------|------------------|----------------------|---|-----------|---------|-------------------|----------------------|-----------|------|
| <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>  |           |         |                  |                      | <b>INDONESIEN</b>                                 |           |         |                   |                      |           |      |
| <b>AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |           |         |                  |                      | PERTAMINA GEOTHERMAL ENERGY 5,15 % 27.04.28       |           |         |                   |                      |           |      |
| <b>ANLEIHEN</b>   |           |         |                  |                      | STAR ENGY GEOTHERMAL WAYANG WINDU 6,75 % 24.04.33 |           |         |                   |                      |           |      |
| <b>ÖSTERREICH</b>   |           |         |                  |                      | TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE 2,75 % 20.01.26      |           |         |                   |                      |           |      |
| KLABIN AUSTRIA 3,2 % 12/01/2031                                   | 2.899.000 | USD     | 2.465.858        | 1,72                 | TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE 2,8 % 02.05.27       | 995.000   | USD     | 913.928           | 0,64                 |           |      |
| SUZANO AUSTRIA 5 % 15.01.30                                       | 1.260.000 | USD     | 1.210.484        | 0,85                 |   |           |         | <b>8.014.496</b>  | <b>5,61</b>          |           |      |
|   |           |         | <b>3.676.342</b> | <b>2,57</b>          | <b>LITAUEN</b>                                    |           |         |                   |                      |           |      |
| <b>CHILE</b>  |           |         |                  |                      | IGNITIS GRUPE 2 % 21.05.30                        |           |         |                   |                      |           |      |
| EMPRESA DE TRANSPORTE DE PASAJERO 4,7 % 07.05.2050                | 3.133.000 | USD     | 2.591.583        | 1,82                 |   |           |         | 1.000.000         | EUR                  | 950.494   | 0,67 |
| INVERSIONES 6,125 % 23.06.33                                      | 200.000   | USD     | 203.858          | 0,14                 |   |           |         | <b>950.494</b>    | <b>0,67</b>          |           |      |
| INVERSIONES CMPC 3 % 06/04/2031                                   | 3.777.000 | USD     | 3.227.524        | 2,26                 | <b>LUXEMBURG</b>                                  |           |         |                   |                      |           |      |
|   |           |         | <b>6.022.965</b> | <b>4,22</b>          | AEGEA FINANCE 9 % 20.01.31                        |           |         |                   |                      |           |      |
| <b>CHINA</b>  |           |         |                  |                      | MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR 5,125 % 15.01.28  |           |         |                   |                      |           |      |
| ENN ENERGY HOLDINGS 2,625 % 17.09.30                              | 2.002.000 | USD     | 1.720.512        | 1,20                 | RAIZEN FUELS FINANCE 6,95 % 05.03.54              | 1.250.000 | USD     | 1.290.215         | 0,90                 |           |      |
|   |           |         | <b>1.720.512</b> | <b>1,20</b>          |   |           |         | <b>4.097.155</b>  | <b>2,87</b>          |           |      |
| <b>KOLUMBIEN</b>  |           |         |                  |                      | <b>MAURITIUS</b>                                  |           |         |                   |                      |           |      |
| BANCOLOMBIA 4,625 % VRN 18.12.29                                  | 2.897.000 | USD     | 2.827.122        | 1,98                 | DIAMOND 7,95 % 28.07.2026                         |           |         |                   |                      |           |      |
|   |           |         | <b>2.827.122</b> | <b>1,98</b>          | GREENKO POWER 4,3 % 13.12.28                      |           |         |                   |                      |           |      |
| <b>TSCHIECHISCHE REPUBLIK</b>                                     |           |         |                  |                      | GREENKO SOLAR MAURITIUS 5,95 % 29.07.26           |           |         |                   |                      |           |      |
| ENERGOPRO 11 % 02.11.2028   | 2.526.000 | USD     | 2.762.119        | 1,93                 | NETWORK 3,975 % VRN PERP                          | 3.100.000 | USD     | 2.948.928         | 2,07                 |           |      |
| ENERGOPRO 8,5 % 04.02.27  | 1.949.000 | USD     | 1.984.477        | 1,39                 |   |           |         | <b>10.445.186</b> | <b>7,32</b>          |           |      |
|   |           |         | <b>4.746.596</b> | <b>3,32</b>          | <b>MEXIKO</b>                                     |           |         |                   |                      |           |      |
| <b>FRANKREICH</b>   |           |         |                  |                      | BANCO MERCANTIL DEL NORTE 6,625 % VRN PERP        |           |         |                   |                      |           |      |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT 2,5 % VRN PERP                               | 2.400.000 | EUR     | 2.335.097        | 1,64                 | CEMEX 9,125 % VRN PERP                            | 1.524.000 | USD     | 1.654.927         | 1,16                 |           |      |
|   |           |         | <b>2.335.097</b> | <b>1,64</b>          | TRUST 6,95 % 30.01.44                             | 650.000   | USD     | 570.849           | 0,40                 |           |      |
| <b>GROSSBRITANNIEN</b>  |           |         |                  |                      |   |           |         |                   |                      |           |      |
| IHS HOLDING 5,625 % 29.11.26                                      | 3.554.000 | USD     | 3.314.730        | 2,32                 |   |           |         | <b>6.148.735</b>  | <b>4,31</b>          |           |      |
|   |           |         | <b>3.314.730</b> | <b>2,32</b>          | <b>POLEN</b>                                      |           |         |                   |                      |           |      |
| <b>HONGKONG</b>   |           |         |                  |                      | CANPACK CANPACK 3,875 % 15.11.29                  |           |         |                   |                      |           |      |
| AIA GROUP 2,7 % VRN PERP  | 1.275.000 | USD     | 1.191.028        | 0,84                 |   |           |         | 1.974.000         | USD                  | 1.748.963 | 1,22 |
| HONGKONG LAND FINANCE 5,25 % 14.07.33                             | 750.000   | USD     | 745.474          | 0,52                 |   |           |         | <b>1.748.963</b>  | <b>1,22</b>          |           |      |
|   |           |         | <b>1.936.502</b> | <b>1,36</b>          | <b>SÜDAFRIKA</b>                                  |           |         |                   |                      |           |      |
| <b>INDIEN</b>   |           |         |                  |                      | ABSA GROUP 6,375 % VRN PERP                       |           |         |                   |                      |           |      |
| RENEW POWER 5,875 % 05/03/2027                                    | 912.000   | USD     | 891.493          | 0,62                 | PERP  | 1.700.000 | USD     | 1.644.131         | 1,15                 |           |      |
| RENEW WIND ENERGY 4,5 % 14.07.28                                  | 4.410.000 | USD     | 4.036.190        | 2,83                 |   |           |         | <b>1.644.131</b>  | <b>1,15</b>          |           |      |
|   |           |         | <b>4.927.683</b> | <b>3,45</b>          | <b>SÜDKOREA</b>                                   |           |         |                   |                      |           |      |
|   |           |         |                  |                      | NONGHYUP BANK 4,875 % 03/07/2028                  |           |         |                   |                      |           |      |
|   |           |         |                  |                      |   |           |         | 2.910.000         | USD                  | 2.898.488 | 2,03 |
|   |           |         |                  |                      | SHINHAN BANK 4,5 % 12/04/2028                     |           |         |                   |                      |           |      |
|   |           |         |                  |                      |   |           |         | 2.288.000         | USD                  | 2.257.151 | 1,58 |
|   |           |         |                  |                      |   |           |         | <b>5.155.639</b>  | <b>3,61</b>          |           |      |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Emerging Markets Corporate Sustainable Bond (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapiieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung   | Nennwert  | Währung | Kurswert          | % des Nettovermögens | Beschreibung                  | Nennwert  | Währung | Kurswert          | % des Nettovermögens |
|--|-----------|---------|-------------------|----------------------|-------------------------------|-----------|---------|-------------------|----------------------|
| <b>VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE</b>                              |           |         |                   |                      | <b>INDIEN</b>                 |           |         |                   |                      |
| ALDAR SUKUK 3,875 %  |           |         |                   |                      | HDFC BANK 5,196 %             |           |         |                   |                      |
| 22.10.29   | 2.830.000 | USD     | 2.654.087         | 1,86                 | 15.02.27                      | 1.450.000 | USD     | 1.441.060         | 1,01                 |
| MAF GLOBAL SECURITIES  |           |         |                   |                      | SHRIRAM FINANCE 6,625 %       |           |         |                   |                      |
| 7,875 % VRN PERP   | 4.000.000 | USD     | 4.199.297         | 2,94                 | 22.04.27                      | 750.000   | USD     | 753.401           | 0,53                 |
|  |           |         | <b>6.853.384</b>  | <b>4,80</b>          | SHRIRAM TRANSPORT             |           |         |                   |                      |
|  |           |         | <b>76.565.732</b> | <b>53,62</b>         | FINANCE 4,15 % 18.07.25       | 1.515.000 | USD     | 1.468.814         | 1,03                 |
| <b>SUMME ANLEIHEN</b>  |           |         |                   |                      |                               |           |         | <b>3.663.275</b>  | <b>2,57</b>          |
| <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN</b>                              |           |         |                   |                      |                               |           |         |                   |                      |
| <b>BÖRSE NOTIERTEN WERTPAPIERE</b>                               |           |         | <b>76.565.732</b> | <b>53,62</b>         |                               |           |         |                   |                      |
| <b>WERTPAPIERE</b>   |           |         |                   |                      | <b>IRLAND</b>                 |           |         |                   |                      |
|  |           |         |                   |                      | C & W SENIOR FINANCING DESIG- |           |         |                   |                      |
| <b>AN EINEM ANDEREM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE, ÜBERTRAGBARE</b> |           |         |                   |                      | NATED 6,875 % 15.09.27        | 3.919.000 | USD     | 3.715.118         | 2,60                 |
| <b>WERTPAPIERE</b>   |           |         |                   |                      |                               |           |         | <b>3.715.118</b>  | <b>2,60</b>          |
|  |           |         |                   |                      | <b>LUXEMBURG</b>              |           |         |                   |                      |
| <b>ANLEIHEN</b>  |           |         |                   |                      | AEGEA FINANCE 6,75 %          |           |         |                   |                      |
|  |           |         |                   |                      | 20.05.29                      | 2.215.000 | USD     | 2.167.248         | 1,52                 |
| <b>BRASILIEN</b>   |           |         |                   |                      | AMBIPAR 9,875 % 06.02.2031    | 3.740.000 | USD     | 3.735.255         | 2,62                 |
| BANCO BRADESCO 4,375 %   |           |         |                   |                      | MILLICOM INTERNATIONAL        |           |         |                   |                      |
| 18.03.27   | 1.258.000 | USD     | 1.221.303         | 0,86                 | CELLULAR 4,5 % 27.04.31       | 1.258.000 | USD     | 1.078.267         | 0,76                 |
| ITAU UNIBANCO HOLDING  |           |         |                   |                      | RAIZEN FUELS FINANCE          |           |         |                   |                      |
| 4,625 % PERP   | 1.616.000 | USD     | 1.516.719         | 1,06                 | 6,45 % 05.03.34               | 233.000   | USD     | 239.242           | 0,17                 |
| ITAU UNIBANCO HOLDING  |           |         |                   |                      | REDE D'OR FINANCE SARL        |           |         |                   |                      |
| 6,125 % VRN PERP   | 1.330.000 | USD     | 1.329.566         | 0,93                 | 4,95 % 17.01.28               | 1.332.000 | USD     | 1.275.853         | 0,89                 |
|  |           |         | <b>4.067.588</b>  | <b>2,85</b>          | RUMO LUXEMBOURG 4,2 %         |           |         |                   |                      |
|  |           |         |                   |                      | 18.01.32                      | 1.738.000 | USD     | 1.472.386         | 1,03                 |
| <b>CHILE</b>   |           |         |                   |                      | RUMO LUXEMBOURG 5,25 %        |           |         |                   |                      |
| EMPRESA DE TRANSPORTE  |           |         |                   |                      | 10/01/2028                    | 3.028.000 | USD     | 2.927.033         | 2,05                 |
| DE PASAJEROS 5 % 25.01.2047                                      | 686.000   | USD     | 595.134           | 0,41                 |                               |           |         | <b>12.895.284</b> | <b>9,04</b>          |
| INVERSIONES CMPC 6,125 %   |           |         |                   |                      | <b>MAURITIUS</b>              |           |         |                   |                      |
| 26.02.34   | 305.000   | USD     | 310.175           | 0,22                 | HTA GROUP 7 % 18.12.2025      | 3.000.000 | USD     | 2.998.771         | 2,10                 |
|  |           |         | <b>905.309</b>    | <b>0,63</b>          | NETWORK 5,65 % VRN PERP       | 1.486.000 | USD     | 1.475.630         | 1,03                 |
|  |           |         |                   |                      |                               |           |         | <b>4.474.401</b>  | <b>3,13</b>          |
| <b>CHINA</b>   |           |         |                   |                      | <b>MEXIKO</b>                 |           |         |                   |                      |
| ENN ENERGY HOLDINGS  |           |         |                   |                      | CEMEX 3,875 % 11.07.31        | 2.000.000 | USD     | 1.777.700         | 1,25                 |
| 4,625 % 17.05.27   | 734.000   | USD     | 720.223           | 0,50                 | CEMEX 5,125 % VRN PERP        | 2.000.000 | USD     | 1.931.774         | 1,35                 |
|  |           |         | <b>720.223</b>    | <b>0,50</b>          | KIMBERLYCLARK DE MEXICO       |           |         |                   |                      |
| <b>COSTA RICA</b>  |           |         |                   |                      | 2,431 % 01.07.31              | 1.500.000 | USD     | 1.273.222         | 0,89                 |
| INVESTMENT ENERGY RESOURCES                                      |           |         |                   |                      | MEXICHEM 4 % 04.10.2027       | 2.000.000 | USD     | 1.894.042         | 1,33                 |
| 6,25 % 26.04.29  | 2.750.000 | USD     | 2.660.059         | 1,86                 | MEXICHEM SAB DE 5,875 %       |           |         |                   |                      |
|  |           |         | <b>2.660.059</b>  | <b>1,86</b>          | 17.09.44                      | 2.500.000 | USD     | 2.279.856         | 1,60                 |
| <b>GROSSBRITANNIEN</b>   |           |         |                   |                      | NEMAK 3,625 % 28.06.31        | 3.000.000 | USD     | 2.425.364         | 1,70                 |
| LIQUID TELECOMMUNICATIONS  |           |         |                   |                      | TRUST 4,869 % 15.01.30        | 3.000.000 | USD     | 2.681.351         | 1,88                 |
| FINANCIAL 5,5 % 04.09.2026                                       | 2.900.000 | USD     | 1.714.459         | 1,20                 | TRUST 6,39 % 15.01.50         | 1.000.000 | USD     | 818.778           | 0,57                 |
|  |           |         | <b>1.714.459</b>  | <b>1,20</b>          | TRUST F 5,25 % 30.01.2026     | 500.000   | USD     | 488.955           | 0,34                 |
|  |           |         |                   |                      |                               |           |         | <b>15.571.042</b> | <b>10,91</b>         |
| <b>GUATEMALA</b>   |           |         |                   |                      | <b>TÜRKEI</b>                 |           |         |                   |                      |
| CT TRUST 5,125 %   |           |         |                   |                      | YAPI VE KREDI BANKASI         |           |         |                   |                      |
| 03/02/2032   | 5.345.000 | USD     | 4.739.152         | 3,32                 | 9,25 % 16.10.28               | 2.554.000 | USD     | 2.719.342         | 1,90                 |
|  |           |         | <b>4.739.152</b>  | <b>3,32</b>          |                               |           |         | <b>2.719.342</b>  | <b>1,90</b>          |
| <b>HONGKONG</b>  |           |         |                   |                      | <b>USA</b>                    |           |         |                   |                      |
| MTR 1,625 % 19.08.30   | 2.639.000 | USD     | 2.197.967         | 1,54                 | MERCADOLIBRE 2,375 %          |           |         |                   |                      |
|  |           |         | <b>2.197.967</b>  | <b>1,54</b>          | 14.01.26                      | 500.000   | USD     | 469.350           | 0,33                 |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



## Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Emerging Markets Corporate Sustainable Bond (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung  | Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|---------------|---------|--------------------|------------------------------|
| MERCADOLIBRE 3,125 %<br>14.01.31  | 1.400.000     | USD     | 1.175.560          | 0,82                         |
|   |               |         | <b>1.644.910</b>   | <b>1,15</b>                  |
| <b>SUMME ANLEIHEN</b>   |               |         | <b>61.688.129</b>  | <b>43,20</b>                 |
| <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN<br/>MARKT GEHANDELTEN ÜBERTRAGBAREN WERTPAPIERE</b> |               |         | <b>61.688.129</b>  | <b>43,20</b>                 |
| <b>SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>  |               |         |                    |                              |
| <b>ANLEIHEN</b>   |               |         |                    |                              |
| <b>NIEDERLANDE</b>  |               |         |                    |                              |
| IHS NETHERLANDS HOLDCO<br>8 % 18.09.27  | 1.962.000     | USD     | 1.879.136          | 1,32                         |
|   |               |         | <b>1.879.136</b>   | <b>1,32</b>                  |
| <b>SUMME ANLEIHEN</b>   |               |         | <b>1.879.136</b>   | <b>1,32</b>                  |
| <b>SUMME SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>                                      |               |         | <b>1.879.136</b>   | <b>1,32</b>                  |
| <b>SUMME WERTPAPIERANLAGEN</b>  |               |         | <b>140.132.997</b> | <b>98,14</b>                 |
| <b>SONSTIGES NETTOVERMÖGEN</b>  |               |         | <b>2.649.737</b>   | <b>1,86</b>                  |
| <b>GESAMTNETTOVERMÖGEN</b>  |               |         | <b>142.782.734</b> | <b>100,00</b>                |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Emerging Markets ESG Bond

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung  | Nennwert  | Währung | Kurswert       | % des Nettovermögens | Beschreibung                                      | Nennwert | Währung   | Kurswert         | % des Nettovermögens |
|---|-----------|---------|----------------|----------------------|---|----------|-----------|------------------|----------------------|
| <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>  |           |         |                |                      |   |          |           |                  |                      |
| <b>AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |           |         |                |                      |   |          |           |                  |                      |
| <b>ANLEIHEN</b>   |           |         |                |                      |   |          |           |                  |                      |
| <b>ARGENTINIEN</b>  |           |         |                |                      | <b>ECOPETROL 8,375 %</b>                          |          |           |                  |                      |
| ARGENTINA (GOVT) 0,125 %<br>09/07/2035                            | 1.472.573 | USD     | 625.844        | 0,73                 | 19.01.36  | 175.000  | USD       | 176.403          | 0,21                 |
|   |           |         | <b>625.844</b> | <b>0,73</b>          | ECOPETROL 8,625 %<br>19.01.29                     | 440.000  | USD       | 466.623          | 0,55                 |
|   |           |         |                |                      | ECOPETROL 8,875 %<br>13.01.33                     | 600.000  | USD       | 635.869          | 0,74                 |
|   |           |         |                |                      |   |          |           | <b>3.090.787</b> | <b>3,62</b>          |
|   |           |         |                |                      | <b>COSTA RICA</b>                                 |          |           |                  |                      |
|   |           |         |                |                      | COSTA RICA (GOVT) 6,55 %<br>03/04/2034            |          |           |                  |                      |
|   |           |         |                |                      | 300.000   | USD      | 310.802   | 0,36             |                      |
|   |           |         |                |                      |   |          |           | <b>310.802</b>   | <b>0,36</b>          |
|   |           |         |                |                      | <b>DOMINIKANISCHE REPUBLIK</b>                    |          |           |                  |                      |
|   |           |         |                |                      | DOMINIKANISCHE REPUBLIK<br>(GOVT) 7,05 % 03.02.31 |          |           |                  |                      |
|   |           |         |                |                      | 670.000   | USD      | 695.104   | 0,81             |                      |
|   |           |         |                |                      |   |          |           | <b>695.104</b>   | <b>0,81</b>          |
|   |           |         |                |                      | <b>ÄGYPTEN</b>                                    |          |           |                  |                      |
|   |           |         |                |                      | EGYPT (GOVT) 5,25 %<br>06/10/2025                 |          |           |                  |                      |
|   |           |         |                |                      | 400.000   | USD      | 385.986   | 0,45             |                      |
|   |           |         |                |                      | EGYPT (GOVT) 7,625 %<br>29.05.32                  |          |           |                  |                      |
|   |           |         |                |                      | 240.000   | USD      | 205.092   | 0,24             |                      |
|   |           |         |                |                      | EGYPT (GOVT) 8,50 %<br>31.01.47                   |          |           |                  |                      |
|   |           |         |                |                      | 600.000   | USD      | 477.702   | 0,56             |                      |
|   |           |         |                |                      | EGYPT (GOVT) 8,7002 %<br>01/03/2049               |          |           |                  |                      |
|   |           |         |                |                      | 1.190.000   | USD      | 966.021   | 1,13             |                      |
|   |           |         |                |                      |   |          |           | <b>2.034.801</b> | <b>2,38</b>          |
|   |           |         |                |                      | <b>EL SALVADOR</b>                                |          |           |                  |                      |
|   |           |         |                |                      | EL SALVADOR (GOVT)<br>7,65 % 15.06.35             |          |           |                  |                      |
|   |           |         |                |                      | 210.000   | USD      | 160.711   | 0,19             |                      |
|   |           |         |                |                      | EL SALVADOR (GOVT)<br>8,25 % 10.04.32             |          |           |                  |                      |
|   |           |         |                |                      | 195.000   | USD      | 162.746   | 0,19             |                      |
|   |           |         |                |                      | EL SALVADOR (GOVT)<br>8,625 % 28.02.29            |          |           |                  |                      |
|   |           |         |                |                      | 50.000  | USD      | 43.704    | 0,05             |                      |
|   |           |         |                |                      |   |          |           | <b>367.161</b>   | <b>0,43</b>          |
|   |           |         |                |                      | <b>GABUN</b>                                      |          |           |                  |                      |
|   |           |         |                |                      | GABONESE (GOVT) 6,95 %<br>16.06.25                |          |           |                  |                      |
|   |           |         |                |                      | 200.000   | USD      | 196.598   | 0,23             |                      |
|   |           |         |                |                      |   |          |           | <b>196.598</b>   | <b>0,23</b>          |
|   |           |         |                |                      | <b>GHANA</b>                                      |          |           |                  |                      |
|   |           |         |                |                      | GHANA (GOVT) 7,875 %<br>26.03.27                  |          |           |                  |                      |
|   |           |         |                |                      | 420.000   | USD      | 218.141   | 0,26             |                      |
|   |           |         |                |                      | GHANA (GOVT) 7,875 %<br>11/02/2035                |          |           |                  |                      |
|   |           |         |                |                      | 300.000   | USD      | 154.837   | 0,18             |                      |
|   |           |         |                |                      | GHANA (GOVT) 8,125 %<br>26.03.32                  |          |           |                  |                      |
|   |           |         |                |                      | 670.000   | USD      | 347.553   | 0,40             |                      |
|   |           |         |                |                      | GHANA (GOVT) 8,627 %<br>16.06.49                  |          |           |                  |                      |
|   |           |         |                |                      | 320.000   | USD      | 162.159   | 0,19             |                      |
|   |           |         |                |                      | GHANA (GOVT) 8,875 %<br>07/05/2042                |          |           |                  |                      |
|   |           |         |                |                      | 200.000   | USD      | 102.333   | 0,12             |                      |
|   |           |         |                |                      | GHANA (GOVT) 8,95 %<br>26.03.51                   |          |           |                  |                      |
|   |           |         |                |                      | 200.000   | USD      | 102.691   | 0,12             |                      |
|   |           |         |                |                      |   |          |           | <b>1.087.714</b> | <b>1,27</b>          |
|   |           |         |                |                      | <b>KOLUMBIEN</b>                                  |          |           |                  |                      |
|   |           |         |                |                      | COLOMBIA (GOVT) 6,125 %<br>18.01.41               |          |           |                  |                      |
|   |           |         |                |                      | 200.000   | USD      | 173.571   | 0,20             |                      |
|   |           |         |                |                      | COLOMBIA (GOVT) 7,5 %<br>02/02/2034               |          |           |                  |                      |
|   |           |         |                |                      | 300.000   | USD      | 306.526   | 0,36             |                      |
|   |           |         |                |                      | COLOMBIA (GOVT) 8 %<br>14.11.35                   |          |           |                  |                      |
|   |           |         |                |                      | 200.000   | USD      | 210.636   | 0,25             |                      |
|   |           |         |                |                      | COLOMBIA (GOVT) 8,75 %<br>14.11.53                |          |           |                  |                      |
|   |           |         |                |                      | 1.030.000   | USD      | 1.121.159 | 1,31             |                      |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Emerging Markets ESG Bond (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung             | Nennwert      | Währung | Kurswert         | % des Nettovermögens | Beschreibung               | Nennwert | Währung | Kurswert         | % des Nettovermögens |
|--------------------------|---------------|---------|------------------|----------------------|----------------------------|----------|---------|------------------|----------------------|
| <b>GUATEMALA</b>         |               |         |                  |                      | <b>KENYA (GOVT) 9,75 %</b> |          |         |                  |                      |
| GUATEMALA (GOVT) 6,125 % |               |         |                  |                      | 16.02.31                   | 470.000  | USD     | 482.334          | 0,56                 |
| 01/06/2050               | 200.000       | USD     | 186.258          | 0,22                 |                            |          |         | <b>873.218</b>   | <b>1,02</b>          |
|                          |               |         | <b>186.258</b>   | <b>0,22</b>          | <b>LUXEMBURG</b>           |          |         |                  |                      |
| <b>UNGARN</b>            |               |         |                  |                      | ACU PETROLEO LUXEMBOURG    |          |         |                  |                      |
| HUNGARY (GOVT) 5,25 %    |               |         |                  |                      | 7,5 % 13.07.35             | 500.000  | USD     | 471.956          | 0,55                 |
| 16.06.29                 | 670.000       | USD     | 664.050          | 0,78                 | 20.01.31                   | 200.000  | USD     | 211.962          | 0,25                 |
| HUNGARY (GOVT) 5,5 %     |               |         |                  |                      | FS LUXEMBOURG 8,875 %      |          |         |                  |                      |
| 16.06.34                 | 400.000       | USD     | 393.964          | 0,46                 | 12/02/2031                 | 350.000  | USD     | 347.057          | 0,41                 |
| HUNGARY (GOVT) 5,5 %     |               |         |                  |                      | RAIZEN FUELS FINANCE       |          |         |                  |                      |
| 26.03.36                 | 260.000       | USD     | 253.031          | 0,30                 | 6,95 % 05.03.54            | 200.000  | USD     | 206.434          | 0,24                 |
| HUNGARY (GOVT) 6,125 %   |               |         |                  |                      |                            |          |         | <b>1.237.409</b> | <b>1,45</b>          |
| 22.05.28                 | 730.000       | USD     | 748.685          | 0,88                 | <b>MEXIKO</b>              |          |         |                  |                      |
| HUNGARY (GOVT) 6,25 %    |               |         |                  |                      | BANCO MERCANTIL DEL        |          |         |                  |                      |
| 22.09.32                 | 500.000       | USD     | 520.589          | 0,61                 | NORTE 6,625 % VRN PERP     |          |         |                  |                      |
| HUNGARY (GOVT) 6,75 %    |               |         |                  |                      | BBVA BANCOMER 8,45 % VRN   |          |         |                  |                      |
| 25.09.52                 | 1.000.000     | USD     | 1.074.974        | 1,26                 | 29.06.38                   |          |         |                  |                      |
| MAGYAR EXPORTIMPORT      |               |         |                  |                      | INFRASTRUCTURA ENERGETICA  |          |         |                  |                      |
| BANK 6,125 % 04.12.27    | 200.000       | USD     | 201.661          | 0,24                 | 4,75 % 15.01.51            |          |         |                  |                      |
|                          |               |         | <b>3.856.954</b> | <b>4,53</b>          | MEXICO (GOVT) 6,338 %      |          |         |                  |                      |
| <b>INDONESIEN</b>        |               |         |                  |                      | 04/05/2053                 |          |         |                  |                      |
| INDONESIA (GOVT) 5,65 %  |               |         |                  |                      | MEXICO (GOVT) 6,4 %        | 200.000  | USD     | 198.112          | 0,23                 |
| 11/01/2053               | 250.000       | USD     | 261.020          | 0,31                 | 07/05/2054                 | 350.000  | USD     | 350.153          | 0,41                 |
| INDONESIA (GOVT) 7,5 %   |               |         |                  |                      | MEXICO (GOVT) 7,5 %        |          |         |                  |                      |
| 15.05.38                 | 6.000.000.000 | IDR     | 400.298          | 0,47                 | 03/06/2027                 | 36.000   | MXN     | 205.094          | 0,24                 |
| PERTAMINA GEOTHERMAL     |               |         |                  |                      | MEXICAN (GOVT) 8,5 %       |          |         |                  |                      |
| ENERGY 5,15 % 27.04.28   | 500.000       | USD     | 498.777          | 0,58                 | 01/03/2029                 | 21.400   | MXN     | 124.702          | 0,15                 |
|                          |               |         | <b>1.160.095</b> | <b>1,36</b>          | MEXICO (GOVT) 8,5 %        |          |         |                  |                      |
| <b>ISRAEL</b>            |               |         |                  |                      | 18.11.38                   |          |         |                  |                      |
| ISRAEL (GOVT) 5,75 %     |               |         |                  |                      | MEXICO CITY AIRPORT        | 15.000   | MXN     | 84.243           | 0,10                 |
| 12/03/2054               | 300.000       | USD     | 288.328          | 0,34                 | TRUST 4,25 % 31.10.26      | 800.000  | USD     | 774.192          | 0,91                 |
|                          |               |         | <b>288.328</b>   | <b>0,34</b>          | MEXICO CITY AIRPORT        |          |         |                  |                      |
| <b>Elfenbeinküste</b>    |               |         |                  |                      | TRUST 5,5 % 31.07.47       |          |         |                  |                      |
| AFRICAN DEVELOPMENT      |               |         |                  |                      | TRUST FIBRA 7,375 %        |          |         |                  |                      |
| BANK 5,75 % VRN PERP     |               |         |                  |                      | 13.02.34                   | 500.000  | USD     | 499.392          | 0,58                 |
| IVORY COAST (GOVT)       |               |         |                  |                      |                            |          |         | <b>3.402.546</b> | <b>3,98</b>          |
| 6,125 % 15.06.33         | 1.000.000     | USD     | 904.496          | 1,06                 | <b>NIEDERLANDE</b>         |          |         |                  |                      |
| IVORY COAST (GOVT)       |               |         |                  |                      | PROSUS 4,193 % 19.01.32    |          |         |                  |                      |
| 7,625 % 30.01.33         | 920.000       | USD     | 914.673          | 1,07                 |                            | 300.000  | USD     | 260.306          | 0,30                 |
| IVORY COAST (GOVT)       |               |         |                  |                      |                            |          |         | <b>260.306</b>   | <b>0,30</b>          |
| 8,25 % 30.01.37          | 400.000       | USD     | 401.946          | 0,47                 | <b>OMAN</b>                |          |         |                  |                      |
|                          |               |         | <b>2.416.427</b> | <b>2,83</b>          | LAMAR FUNDING 3,958 %      |          |         |                  |                      |
| <b>KASACHSTAN</b>        |               |         |                  |                      | 07/05/2025                 |          |         |                  |                      |
| KAZMUNAYGAS NATIONAL     |               |         |                  |                      | OMAN (GOVT) 5,625 %        | 500.000  | USD     | 488.172          | 0,57                 |
| 4,75 % 19.04.27          | 1.000.000     | USD     | 976.081          | 1,14                 | 17.01.28                   | 640.000  | USD     | 644.108          | 0,75                 |
| KAZMUNAYGAS NATIONAL     |               |         |                  |                      | OMAN (GOVT) 6 % 01.08.2029 | 300.000  | USD     | 307.343          | 0,36                 |
| 5,75 % 19.04.47          | 400.000       | USD     | 348.784          | 0,41                 | OMAN (GOVT) 7 % 25.01.51   | 200.000  | USD     | 210.923          | 0,25                 |
|                          |               |         | <b>1.324.865</b> | <b>1,55</b>          |                            |          |         | <b>1.650.546</b> | <b>1,93</b>          |
| <b>KENIA</b>             |               |         |                  |                      | <b>PANAMA</b>              |          |         |                  |                      |
| KENYA (GOVT) 7 %         |               |         |                  |                      | PANAMA (GOVT) 6,853 %      |          |         |                  |                      |
| 22.05.27                 | 400.000       | USD     | 390.884          | 0,46                 | 28.03.54                   |          |         |                  |                      |
|                          |               |         |                  |                      |                            | 300.000  | USD     | 277.939          | 0,33                 |
|                          |               |         |                  |                      |                            |          |         | <b>277.939</b>   | <b>0,33</b>          |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Emerging Markets ESG Bond (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapiieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung                                    | Nennwert      | Währung | Kurswert         | % des Nettovermögens | Beschreibung  | Nennwert  | Währung | Kurswert         | % des Nettovermögens |
|---|---------------|---------|------------------|----------------------|---|-----------|---------|------------------|----------------------|
| <b>PARAGUAY</b>                                 |               |         |                  |                      | ROMANIA (GOVT) 7,625 %                              |           |         |                  |                      |
| PARAGUAY (GOVT) 5,85 %<br>21.08.33              | 540.000       | USD     | 541.989          | 0,63                 | 17.01.53  | 380.000   | USD     | 422.256          | 0,49                 |
| PARAGUAY (GOVT) 7,9 %<br>09/02/2031             | 3.650.000.000 | PYG     | 512.463          | 0,60                 |   |           |         | <b>2.301.647</b> | <b>2,70</b>          |
|   |               |         | <b>1.054.452</b> | <b>1,23</b>          | <b>SAUDI-ARABIEN</b>                                |           |         |                  |                      |
| <b>PERU</b>                                     |               |         |                  |                      | GACI FIRST INVESTMENT<br>4,75 % 14.02.30            | 800.000   | USD     | 784.730          | 0,92                 |
| BANCO DE CREDITO DEL<br>PERU 5,85 % 11.01.29    | 300.000       | USD     | 303.565          | 0,36                 | GACI FIRST INVESTMENT<br>4,875 % 14.02.35           | 750.000   | USD     | 717.145          | 0,84                 |
| PETROLEOS DEL PERU<br>4,75 % 19.06.32           | 550.000       | USD     | 432.709          | 0,51                 | GACI FIRST INVESTMENT<br>5,375 % 29.01.54           | 200.000   | USD     | 178.301          | 0,21                 |
| PETROLEOS DEL PERU<br>5,625 % 19.06.47          | 800.000       | USD     | 535.021          | 0,62                 | SAUDI ARABIA (GOVT)<br>4,5 % 17.04.30               | 200.000   | USD     | 196.289          | 0,23                 |
|   |               |         | <b>1.271.295</b> | <b>1,49</b>          | SAUDI ARABIA (GOVT) 5 %<br>17.04.49                 | 300.000   | USD     | 273.691          | 0,32                 |
| <b>PHILIPPINEN</b>                              |               |         |                  |                      | SAUDI ARABIA (GOVT)<br>5,25 % 16.01.50              | 700.000   | USD     | 661.940          | 0,78                 |
| PHILIPPINES (GOVT)<br>5,95 % 13.10.47           | 300.000       | USD     | 321.327          | 0,38                 | SAUDI ARABIA (GOVT) 5,75 %<br>16.01.54              | 700.000   | USD     | 694.108          | 0,81                 |
|   |               |         | <b>321.327</b>   | <b>0,38</b>          | SUCI SECOND INVESTMENT<br>6 % 25.10.28              | 200.000   | USD     | 207.045          | 0,24                 |
| <b>POLEN</b>                                    |               |         |                  |                      |   |           |         | <b>3.713.249</b> | <b>4,35</b>          |
| BANK GOSPODARSTWA KRAJOWEGO<br>5,375 % 22.05.33 | 270.000       | USD     | 269.309          | 0,32                 | <b>SENEGAL</b>                                      |           |         |                  |                      |
| BANK GOSPODARSTWA KRAJOWEGO<br>6,25 % 31.10.28  | 200.000       | USD     | 208.722          | 0,24                 | SENEGAL (GOVT) 6,25 %<br>23.05.33                   | 200.000   | USD     | 170.971          | 0,20                 |
| POLAND (GOVT) 4,875 %<br>04/10/2033             | 310.000       | USD     | 306.104          | 0,36                 |   |           |         | <b>170.971</b>   | <b>0,20</b>          |
| POLAND (GOVT) 5,125 %<br>18.09.34               | 120.000       | USD     | 119.784          | 0,14                 | <b>SÜDAFRIKA</b>                                    |           |         |                  |                      |
| POLAND (GOVT) 5,5 %<br>16.11.27                 | 220.000       | USD     | 225.089          | 0,26                 | ABSA GROUP 6,375 % VRN<br>PERP                      | 240.000   | USD     | 232.113          | 0,27                 |
| POLAND (GOVT) 5,5 %<br>04/04/2053               | 500.000       | USD     | 499.688          | 0,59                 | SOUTH AFRICA (GOVT)<br>5,75 % 30.09.49              | 400.000   | USD     | 291.184          | 0,34                 |
| POLAND (GOVT) 5,75 %<br>16.11.32                | 200.000       | USD     | 209.704          | 0,25                 | SOUTH AFRICA (GOVT)<br>6,25 % 08.03.41              | 140.000   | USD     | 115.846          | 0,14                 |
|   |               |         | <b>1.838.400</b> | <b>2,16</b>          |   |           |         | <b>639.143</b>   | <b>0,75</b>          |
| <b>KATAR</b>                                    |               |         |                  |                      | <b>SRI LANKA</b>                                    |           |         |                  |                      |
| QATAR (GOVT) 4,4 %<br>16.04.50                  | 420.000       | USD     | 372.183          | 0,44                 | SRI LANKA (GOVT) 6,85 %<br>14.03.2024*              | 600.000   | USD     | 331.500          | 0,39                 |
| QATAR (GOVT) 4,817 %<br>14.03.49                | 500.000       | USD     | 469.526          | 0,55                 | SRI LANKA (GOVT) 7,55 %<br>28.03.30                 | 1.000.000 | USD     | 589.916          | 0,69                 |
| QATAR (GOVT) 5,103 %<br>23.04.48                | 500.000       | USD     | 487.694          | 0,57                 |   |           |         | <b>921.416</b>   | <b>1,08</b>          |
|   |               |         | <b>1.329.403</b> | <b>1,56</b>          | <b>TRINIDAD &amp; TOBAGO</b>                        |           |         |                  |                      |
| <b>RUMÄNIEN</b>                                 |               |         |                  |                      | TRINIDAD & TOBAGO<br>(GOVT) 5,95 % 14.01.2031       | 1.200.000 | USD     | 1.206.071        | 1,41                 |
| ROMANIAN (GOVT) 5,25 %<br>25.11.27              | 730.000       | USD     | 720.738          | 0,85                 |   |           |         | <b>1.206.071</b> | <b>1,41</b>          |
| ROMANIAN (GOVT) 5,625 %<br>22.02.36             | 300.000       | EUR     | 323.492          | 0,38                 | <b>TÜRKEI</b>                                       |           |         |                  |                      |
| ROMANIAN (GOVT) 6,375 %<br>30.01.34             | 400.000       | USD     | 406.435          | 0,48                 | HAZINE MUSTESARLIGI VARLIK<br>KIRA 9,758 % 13.11.25 | 200.000   | USD     | 211.013          | 0,25                 |
| ROMANIA (GOVT) 7,125 %<br>17.01.33              | 400.000       | USD     | 428.726          | 0,50                 | TURKEY (GOVT) 9,125 %<br>13.07.30                   | 850.000   | USD     | 922.336          | 1,08                 |
|   |               |         |                  |                      | TURKEY (GOVT) 9,375 %<br>14.03.29                   | 300.000   | USD     | 327.005          | 0,38                 |
|   |               |         |                  |                      | TURKEY (GOVT) 9,875 %<br>15.01.28                   | 450.000   | USD     | 496.411          | 0,58                 |

\* Der Vermögenswert, der am 14. März 2024 fällig war, ist notleidend. Zur Bewertung wurde der letzte verfügbare Preis auf dem Markt herangezogen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Emerging Markets ESG Bond (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapiieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung  | Nennwert  | Währung | Kurswert          | % des Nettovermögens | Beschreibung   | Nennwert  | Währung | Kurswert         | % des Nettovermögens |
|---|-----------|---------|-------------------|----------------------|--|-----------|---------|------------------|----------------------|
| TURKIYE VARLIK FONU<br>YONETIMI 8,25 % 14.02.2029                   | 470.000   | USD     | 479.619           | 0,56                 | <b>AN EINEM ANDEREM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE, ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |           |         |                  |                      |
|   |           |         | <b>2.436.384</b>  | <b>2,85</b>          | <b>ANLEIHEN</b>  |           |         |                  |                      |
| <b>UKRAINE</b>  |           |         |                   |                      | <b>ARGENTINIEN</b>   |           |         |                  |                      |
| UKRAINE (GOVT) 0 % VRN<br>31.05.40                                  | 570.000   | USD     | 317.753           | 0,37                 | ARGENTINA (GOVT) 0,125 %<br>09/07/2030                                       | 1.791.639 | USD     | 931.757          | 1,09                 |
| UKRAINE (GOVT) 7,375 %<br>25.09.32                                  | 790.000   | USD     | 233.138           | 0,27                 | ARGENTINA (GOVT) 0,125 %<br>09/01/2038                                       | 788.000   | USD     | 367.066          | 0,43                 |
| UKRAINE (GOVT) 7,75 %<br>01/09/2024                                 | 400.000   | USD     | 151.097           | 0,18                 | ARGENTINA (GOVT) 0,125 %<br>09/07/2041                                       | 1.016.606 | USD     | 412.436          | 0,48                 |
| UKRAINE (GOVT) 7,75 %<br>01/09/2025                                 | 250.000   | USD     | 94.049            | 0,11                 | ARGENTINE (GOVT) 0,125 %<br>09.07.46 STEP                                    | 170.000   | USD     | 76.921           | 0,09                 |
| UKRAINE (GOVT) 7,75 %<br>01/09/2027                                 | 750.000   | USD     | 248.704           | 0,29                 |  |           |         | <b>1.788.180</b> | <b>2,09</b>          |
|   |           |         | <b>1.044.741</b>  | <b>1,22</b>          | <b>BRASILIEN</b>   |           |         |                  |                      |
| <b>VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE</b>                                 |           |         |                   |                      | BANCO DO BRASIL 6 %<br>18.03.31  | 330.000   | USD     | 330.790          | 0,39                 |
| ABU DHABI (GOVT) 4,125 %<br>11/10/2047                              | 560.000   | USD     | 473.645           | 0,55                 | BRAZIL (GOVT) 4,75 %<br>14.01.50   | 200.000   | USD     | 150.376          | 0,18                 |
| ABU DHABI COMMERCIAL<br>BANK 4,5 % 14.09.27                         | 600.000   | USD     | 588.804           | 0,70                 | BRAZILIAN (GOVT) 6,25 %<br>18.03.31  | 700.000   | USD     | 714.862          | 0,83                 |
| MDGH GMTN 5,084 %<br>22.05.53                                       | 200.000   | USD     | 189.953           | 0,22                 | MC BRAZIL DOWNSTREAM<br>TRADING 7,25 % 30.06.2031                            | 600.000   | USD     | 518.655          | 0,61                 |
| MDGH GMTN 5,875 %<br>01/05/2034                                     | 200.000   | USD     | 213.167           | 0,25                 |  |           |         | <b>1.714.683</b> | <b>2,01</b>          |
|   |           |         | <b>1.465.569</b>  | <b>1,72</b>          | <b>CHILE</b>   |           |         |                  |                      |
| <b>USA</b>  |           |         |                   |                      | CHILE (GOVT) 3,5 %<br>25.01.50   | 400.000   | USD     | 293.548          | 0,34                 |
| BIMBO BAKERIES 6,4 %<br>15.01.34                                    | 400.000   | USD     | 429.879           | 0,50                 | CHILE (GOVT) 4,34 %<br>07/03/2042  | 1.300.000 | USD     | 1.137.474        | 1,33                 |
| US (GOVT) 3,875 %<br>15.08.33                                       | 150.000   | USD     | 146.285           | 0,17                 | CORP NACIONAL DEL COBRE<br>DE CHILE 4,5 % 01.08.47                           | 200.000   | USD     | 158.130          | 0,19                 |
| US (GOVT) 4 % 30.06.28  | 400.000   | USD     | 395.938           | 0,46                 | EMPRESA NACIONAL DEL<br>PETROLEO 3,75 % 05.08.2026                           | 500.000   | USD     | 478.132          | 0,56                 |
| US (GOVT) 4,125 %<br>15.11.32                                       | 1.150.000 | USD     | 1.143.890         | 1,35                 | INVERSIONES CMPC 6,125 %<br>26.02.34   | 200.000   | USD     | 203.393          | 0,24                 |
| US (GOVT) 4,5 % 15.11.33  | 900.000   | USD     | 921.445           | 1,08                 |  |           |         | <b>2.270.677</b> | <b>2,66</b>          |
| US (GOVT) 4,75 %<br>15.11.53  | 160.000   | USD     | 171.325           | 0,20                 | <b>KOLUMBIEN</b>   |           |         |                  |                      |
| US (GOVT) 4,875 %<br>31.10.28                                       | 400.000   | USD     | 410.453           | 0,48                 | ECOPETROL 5,375 %<br>26.06.26  | 110.000   | USD     | 108.278          | 0,13                 |
|   |           |         | <b>3.619.215</b>  | <b>4,24</b>          |  |           |         | <b>108.278</b>   | <b>0,13</b>          |
| <b>URUGUAY</b>  |           |         |                   |                      | <b>COSTA RICA</b>  |           |         |                  |                      |
| URUGUAY (GOVT) 5,75 %<br>28.10.34                                   | 1.775.000 | USD     | 1.876.174         | 2,20                 | COSTA RICA (GOVT)<br>4,375 % 30.04.25  | 700.000   | USD     | 691.810          | 0,81                 |
|   |           |         | <b>1.876.174</b>  | <b>2,20</b>          | COSTA RICA (GOVT)<br>6,125 % 19.02.31  | 1.100.000 | USD     | 1.115.677        | 1,32                 |
| <b>SAMBIA</b>   |           |         |                   |                      | COSTA RICA (GOVT) 7 %<br>04/04/2044  | 200.000   | USD     | 207.364          | 0,24                 |
| ZAMBIA (GOVT) 8,97 %<br>30.07.27                                    | 200.000   | USD     | 147.687           | 0,17                 | COSTA RICA (GOVT)<br>7,158 % 12.03.45  | 500.000   | USD     | 524.384          | 0,61                 |
|   |           |         | <b>147.687</b>    | <b>0,17</b>          | COSTA RICA (GOVT) 7,3 %<br>13.11.54  | 750.000   | USD     | 798.263          | 0,93                 |
| <b>SUMME ANLEIHEN</b>   |           |         | <b>55.772.341</b> | <b>65,31</b>         |  |           |         |                  |                      |
| <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN<br/>BÖRSE NOTIERTEN WERTPAPIERE</b> |           |         | <b>55.772.341</b> | <b>65,31</b>         |  |           |         |                  |                      |
| <b>WERTPAPIERE</b>  |           |         |                   |                      |  |           |         |                  |                      |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Emerging Markets ESG Bond (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapiieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung   | Nennwert  | Währung | Kurswert         | % des Nettovermögens | Beschreibung                                      | Nennwert  | Währung | Kurswert         | % des Nettovermögens |
|--|-----------|---------|------------------|----------------------|---|-----------|---------|------------------|----------------------|
| INSTITUTO COSTARRICENSE DE ELECTRICIDAD 6,75 %<br>07/10/2031 | 400.000   | USD     | 404.288          | 0,47                 | <b>MEXIKO</b>                                     |           |         |                  |                      |
|  |           |         | <b>3.741.786</b> | <b>4,38</b>          | BANCO MERCANTIL DEL NORTE SAGRAN 5,875 % VRN PERP | 650.000   | USD     | 622.136          | 0,73                 |
| <b>DOMINIKANISCHE REPUBLIK</b>                               |           |         |                  |                      | BANCO SANTANDER MEXICO 5,375 % 17.04.25           | 300.000   | USD     | 298.910          | 0,35                 |
| DOMINIC (GOVT) 5,3 %   |           |         |                  |                      | BBVA BANCOMER TEXAS 5,875 % VRN 13.09.34          | 400.000   | USD     | 378.587          | 0,44                 |
| 21.01.41   | 800.000   | USD     | 681.193          | 0,80                 | INFRAESTRUCTURA ENERGETICA NOVA 3,75 % 14.01.28   | 200.000   | USD     | 188.080          | 0,22                 |
| DOMINIC (GOVT) 5,5 %   |           |         |                  |                      | MEXICO (GOVT) 4,75 % 27.04.32                     | 200.000   | USD     | 190.064          | 0,22                 |
| 22.02.29   | 300.000   | USD     | 291.804          | 0,34                 | MEXICO (GOVT) 5 % 27.04.51                        | 250.000   | USD     | 211.013          | 0,25                 |
| DOMINIC (GOVT) 5,875 %                                       |           |         |                  |                      | TRUST 4,869 % 15.01.30                            | 200.000   | USD     | 178.757          | 0,21                 |
| 30.01.60   | 325.000   | USD     | 276.987          | 0,32                 |   |           |         | <b>2.067.547</b> | <b>2,42</b>          |
| DOMINIC (GOVT) 6 %   |           |         |                  |                      | <b>NIEDERLANDE</b>                                |           |         |                  |                      |
| 22.02.33   | 260.000   | USD     | 253.210          | 0,30                 | PROSUS 3,257 % 19.01.27                           | 400.000   | USD     | 371.183          | 0,43                 |
| DOMINIC (GOVT) 6,4 %   |           |         |                  |                      |   |           |         | <b>371.183</b>   | <b>0,43</b>          |
| 05/06/2049   | 800.000   | USD     | 753.166          | 0,89                 | <b>OMAN</b>                                       |           |         |                  |                      |
| DOMINIC (GOVT) 6,5 %   |           |         |                  |                      | OMAN (GOVT) 6,5 % 08/03/2047                      | 335.000   | USD     | 338.491          | 0,40                 |
| 15.02.48   | 200.000   | USD     | 190.530          | 0,22                 |   |           |         | <b>338.491</b>   | <b>0,40</b>          |
|  |           |         | <b>2.446.890</b> | <b>2,87</b>          | <b>PANAMA</b>                                     |           |         |                  |                      |
| <b>ECUADOR</b>   |           |         |                  |                      | PANAMA (GOVT) 7,875 % 01/03/2057                  | 200.000   | USD     | 205.861          | 0,24                 |
| ECUADOR (GOVT) 0,5 %   |           |         |                  |                      | PANAMA (GOVT) 8 % 01/03/2038                      | 280.000   | USD     | 298.222          | 0,35                 |
| 31.07.30   | 1.048.000 | USD     | 713.139          | 0,84                 |   |           |         | <b>504.083</b>   | <b>0,59</b>          |
| ECUADOR (GOVT) 0,5 %   |           |         |                  |                      | <b>PARAGUAY</b>                                   |           |         |                  |                      |
| 31.07.35   | 1.220.000 | USD     | 643.863          | 0,75                 | PARAGUAY (GOVT) 5,4 % 30.03.50                    | 600.000   | USD     | 529.348          | 0,62                 |
| ECUADOR (GOVT) 0,5 %   |           |         |                  |                      |   |           |         | <b>529.348</b>   | <b>0,62</b>          |
| 31.07.40   | 225.000   | USD     | 109.634          | 0,13                 | <b>PERU</b>                                       |           |         |                  |                      |
|  |           |         | <b>1.466.636</b> | <b>1,72</b>          | BANCO INTERNACIONAL DEL PERU 3,25 % 04.10.26      | 150.000   | USD     | 141.634          | 0,17                 |
| <b>EL SALVADOR</b>   |           |         |                  |                      | PERU (GOVT) 3 % 15.01.2034                        | 1.071.000 | USD     | 878.816          | 1,02                 |
| EL SALVADOR (GOVT) 6,375 % 18.01.27                          | 200.000   | USD     | 174.618          | 0,20                 | PERU (GOVT) 3,3 % 11/03/2041                      | 280.000   | USD     | 210.684          | 0,25                 |
| EL SALVADOR (GOVT) 7,625 % 01.02.41                          | 150.000   | USD     | 110.355          | 0,13                 |   |           |         | <b>1.231.134</b> | <b>1,44</b>          |
|  |           |         | <b>284.973</b>   | <b>0,33</b>          | <b>POLEN</b>                                      |           |         |                  |                      |
| <b>INDONESIEN</b>  |           |         |                  |                      | POLAND (GOVT) 5,5 % 18.03.54                      | 360.000   | USD     | 358.516          | 0,42                 |
| INDONESIA (GOVT) 3,55 % 09/06/2051                           | 1.200.000 | USD     | 892.876          | 1,05                 |   |           |         | <b>358.516</b>   | <b>0,42</b>          |
|  |           |         | <b>892.876</b>   | <b>1,05</b>          | <b>SÜDAFRIKA</b>                                  |           |         |                  |                      |
| <b>JERSEY</b>  |           |         |                  |                      | SOUTH AFRICA (GOVT) 4,3 % 12.10.28                | 400.000   | USD     | 359.782          | 0,42                 |
| GALAXY PIPELINE ASSETS 2,94 % 30.09.40                       | 400.000   | USD     | 300.579          | 0,35                 |   |           |         | <b>359.782</b>   | <b>0,42</b>          |
|  |           |         | <b>300.579</b>   | <b>0,35</b>          | <b>VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE</b>               |           |         |                  |                      |
| <b>LUXEMBURG</b>   |           |         |                  |                      | ABU DHABI CRUDE OIL PIPELINE 4,6 % 02.11.2047     | 350.000   | USD     | 314.772          | 0,37                 |
| AEGEA FINANCE 6,75 % 20.05.29                                | 200.000   | USD     | 195.688          | 0,23                 |   |           |         | <b>314.772</b>   | <b>0,37</b>          |
| CHILE ELECTRICITY 6,01 % 20.01.33                            | 250.000   | USD     | 253.713          | 0,30                 |   |           |         |                  |                      |
| MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR 7,375 % 02.04.2032           | 400.000   | USD     | 400.501          | 0,47                 |   |           |         |                  |                      |
| RAIZEN FUELS FINANCE 6,45 % 05.03.34                         | 200.000   | USD     | 205.358          | 0,24                 |   |           |         |                  |                      |
| RUMO LUXEMBOURG 5,25 % 10/01/2028                            | 250.000   | USD     | 241.664          | 0,28                 |   |           |         |                  |                      |
|  |           |         | <b>1.296.924</b> | <b>1,52</b>          |   |           |         |                  |                      |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Emerging Markets ESG Bond (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung  | Nennwert  | Währung | Kurswert          | % des Nettovermögens |
|---|-----------|---------|-------------------|----------------------|
| <b>USA</b>  |           |         |                   |                      |
| KOSMOS ENERGY 7,75 %<br>01/05/2027  | 400.000   | USD     | 395.405           | 0,46                 |
| US (GOVT) 4 % 15.11.52  | 1.000.000 | USD     | 943.203           | 1,11                 |
|   |           |         | <b>1.338.608</b>  | <b>1,57</b>          |
| <b>URUGUAY</b>  |           |         |                   |                      |
| URUGUAY (GOVT) 4,375 %<br>23.01.31  | 790.000   | USD     | 774.522           | 0,91                 |
| URUGUAY (GOVT) 4,975 %<br>20.04.55  | 60.000    | USD     | 56.421            | 0,07                 |
| URUGUAY (GOVT) 5,1 %<br>18.06.50  | 1.550.000 | USD     | 1.501.967         | 1,75                 |
|   |           |         | <b>2.332.910</b>  | <b>2,73</b>          |
| <b>SAMBIA</b>   |           |         |                   |                      |
| ZAMBIA (GOVT) 8,5 %<br>14.04.24   | 600.000   | USD     | 444.173           | 0,52                 |
|   |           |         | <b>444.173</b>    | <b>0,52</b>          |
| <b>SUMME ANLEIHEN</b>   |           |         | <b>26.503.029</b> | <b>31,04</b>         |
| <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN<br/>MARKT GEHANDELTEN ÜBERTRAGBAREN WERTPAPIERE</b> |           |         | <b>26.503.029</b> | <b>31,04</b>         |
| <b>GELDMARKTINSTRUMENTE</b>   |           |         |                   |                      |
| <b>SCHATZWECHSEL</b>  |           |         |                   |                      |
| <b>USA</b>  |           |         |                   |                      |
| US (GOVT) 0 % 07.05.24  | 2.850.000 | USD     | 2.835.031         | 3,32                 |
|   |           |         | <b>2.835.031</b>  | <b>3,32</b>          |
| <b>SUMME SCHATZWECHSEL</b>  |           |         | <b>2.835.031</b>  | <b>3,32</b>          |
|   |           |         | <b>2.835.031</b>  | <b>3,32</b>          |
| <b>GELDMARKTINSTRUMENTE GESAMT</b>  |           |         |                   |                      |
| <b>SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>  |           |         |                   |                      |
| <b>ANLEIHEN</b>   |           |         |                   |                      |
| <b>CHILE</b>  |           |         |                   |                      |
| CORP NACIONAL DEL COBRE<br>DE CHILE 3 % 30.09.29                                    | 200.000   | USD     | 177.178           | 0,21                 |
|   |           |         | <b>177.178</b>    | <b>0,21</b>          |
| <b>SUMME ANLEIHEN</b>   |           |         | <b>177.178</b>    | <b>0,21</b>          |
| <b>SUMME SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>                                      |           |         | <b>177.178</b>    | <b>0,21</b>          |
| <b>SUMME WERTPAPIERANLAGEN</b>  |           |         | <b>85.287.579</b> | <b>99,88</b>         |
| <b>SONSTIGES NETTOVERMÖGEN</b>  |           |         | <b>104.785</b>    | <b>0,12</b>          |
| <b>GESAMTNETTOVERMÖGEN</b>  |           |         | <b>85.392.364</b> | <b>100,00</b>        |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Emerging Markets ESG Local Debt  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung                          | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|---------------------------------------|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|
| <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>  |                          |         |                   |                              | <b>HONGKONG</b>                       |                          |         |                   |                              |
| <b>AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |                          |         |                   |                              | HONG KONG (GOVT) 2,8 %<br>30.11.24    |                          |         |                   |                              |
|   |                          |         |                   |                              |                                       | 8.500.000                | CNY     | 1.172.629         | 0,42                         |
|   |                          |         |                   |                              |                                       |                          |         | <b>1.172.629</b>  | <b>0,42</b>                  |
| <b>ANLEIHEN</b>   |                          |         |                   |                              | <b>UNGARN</b>                         |                          |         |                   |                              |
| <b>BRASILIEN</b>  |                          |         |                   |                              | HUNGARY (GOVT) 4 %<br>28.04.51        |                          |         |                   |                              |
| BRAZIL (GOVT) 0 %<br>01/07/2024                                   | 11.085                   | BRL     | 2.162.028         | 0,77                         |                                       | 400.000.000              | HUF     | 728.474           | 0,26                         |
| BRAZIL (GOVT) 10 %<br>01/01/2027                                  | 8.000                    | BRL     | 1.591.930         | 0,57                         |                                       |                          |         |                   |                              |
| BRAZIL (GOVT) 10 %<br>01/01/2029                                  | 49.700                   | BRL     | 9.721.786         | 3,46                         |                                       |                          |         |                   |                              |
| BRAZIL (GOVT) 10 %<br>01/01/2031                                  | 13.700                   | BRL     | 2.634.875         | 0,94                         |                                       | 2.370.000.000            | HUF     | 5.619.028         | 2,00                         |
| BRAZIL (GOVT) 10 %<br>01/01/2033                                  | 38.500                   | BRL     | 7.324.485         | 2,61                         |                                       |                          |         | <b>6.347.502</b>  | <b>2,26</b>                  |
|   |                          |         | <b>23.435.104</b> | <b>8,35</b>                  | <b>INDONESIEN</b>                     |                          |         |                   |                              |
| <b>CHILE</b>  |                          |         |                   |                              | INDONESIA (GOVT) 6,625 %<br>15.05.33  |                          |         |                   |                              |
| BONOS DE LA TESORERIA DE<br>LA REPUBLIC 6 % 01.04.2033            | 660.000.000              | CLP     | 663.475           | 0,24                         |                                       | 24.000.000.000           | IDR     | 1.512.337         | 0,54                         |
| CHILE (GOVT) 2,3 %<br>01/10/2028                                  | 3.590.000.000            | CLP     | 3.137.589         | 1,11                         |                                       |                          |         |                   |                              |
| CHILE (GOVT) 2,8 %<br>01/10/2033                                  | 2.200.000.000            | CLP     | 1.735.385         | 0,62                         |                                       | 54.200.000.000           | IDR     | 3.500.265         | 1,25                         |
| CHILE (GOVT) 4,5 %<br>01/03/2026                                  | 1.000.000.000            | CLP     | 999.538           | 0,36                         |                                       |                          |         |                   |                              |
|   |                          |         | <b>6.535.987</b>  | <b>2,33</b>                  |                                       | 80.900.000.000           | IDR     | 5.402.864         | 1,91                         |
| <b>KOLUMBIEN</b>  |                          |         |                   |                              |                                       | 55.000.000.000           | IDR     | 3.669.402         | 1,31                         |
| COLOMBIA (GOVT) 7 %<br>26.03.31                                   | 54.246.100.000           | COP     | 12.221.226        | 4,34                         |                                       |                          |         | <b>14.084.868</b> | <b>5,01</b>                  |
| COLOMBIA (GOVT) 7,25 %<br>26.10.50                                | 1.800.000.000            | COP     | 328.804           | 0,12                         | <b>MALAYSIA</b>                       |                          |         |                   |                              |
|   |                          |         | <b>12.550.030</b> | <b>4,46</b>                  | MALAYSIA (GOVT) 2,632 %<br>15.04.31   |                          |         |                   |                              |
| <b>TSCHECHISCHE REPUBLIK</b>                                      |                          |         |                   |                              | MALAYSIA (GOVT) 3,733 %<br>15.06.28   |                          |         |                   |                              |
| CZECH (GOVT) 0,95 %<br>15.05.30                                   | 34.400.000               | CZK     | 1.246.587         | 0,44                         |                                       | 17.400.000               | MYR     | 3.699.159         | 1,32                         |
| CZECH (GOVT) 2,4 %<br>17.09.25                                    | 78.600.000               | CZK     | 3.291.227         | 1,17                         |                                       |                          |         |                   |                              |
|   |                          |         | <b>4.537.814</b>  | <b>1,61</b>                  |                                       | 17.500.000               | MYR     | 3.744.165         | 1,33                         |
| <b>DOMINIKANISCHE REPUBLIK</b>                                    |                          |         |                   |                              |                                       | 11.000.000               | MYR     | 2.353.193         | 0,84                         |
| DOMINICAN (GOVT) 11,25 %<br>15.09.35                              | 8.000.000                | DOP     | 146.421           | 0,05                         |                                       | 8.500.000                | MYR     | 1.766.142         | 0,63                         |
| DOMINIKANISCHE REPUBLIK<br>(GOVT) 13,625 % 03.02.33               | 15.000.000               | DOP     | 306.859           | 0,11                         |                                       | 24.100.000               | MYR     | 5.257.180         | 1,86                         |
|   |                          |         | <b>453.280</b>    | <b>0,16</b>                  |                                       |                          |         | <b>18.000.477</b> | <b>6,40</b>                  |
| <b>DEUTSCHLAND</b>  |                          |         |                   |                              | <b>MEXIKO</b>                         |                          |         |                   |                              |
| KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU<br>0,625 % 25.07.25               | 31.000.000               | PLN     | 7.261.981         | 2,58                         | MEX BONOS DESARR 5,75 %<br>05/03/2026 |                          |         |                   |                              |
| KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU<br>2,9 % 24.02.26                 | 34.000.000               | CNY     | 4.711.195         | 1,68                         |                                       | 284.000                  | MXN     | 1.581.686         | 0,56                         |
|   |                          |         | <b>11.973.176</b> | <b>4,26</b>                  |                                       |                          |         |                   |                              |
|   |                          |         |                   |                              |                                       | 754.000                  | MXN     | 4.316.454         | 1,54                         |
|   |                          |         |                   |                              |                                       |                          |         |                   |                              |
|   |                          |         |                   |                              |                                       | 1.834.000                | MXN     | 10.448.406        | 3,72                         |
|   |                          |         |                   |                              |                                       |                          |         |                   |                              |
|   |                          |         |                   |                              |                                       |                          |         |                   |                              |
|   |                          |         |                   |                              |                                       | 418.000                  | MXN     | 2.248.424         | 0,80                         |
|   |                          |         |                   |                              |                                       |                          |         |                   |                              |
|   |                          |         |                   |                              |                                       | 950.000                  | MXN     | 5.268.102         | 1,87                         |
|   |                          |         |                   |                              |                                       |                          |         |                   |                              |
|   |                          |         |                   |                              |                                       |                          |         |                   |                              |
|   |                          |         |                   |                              |                                       | 13.11.42                 | MXN     | 1.499.786         | 0,53                         |
|   |                          |         |                   |                              |                                       |                          |         |                   |                              |
|   |                          |         |                   |                              |                                       | 372.400                  | MXN     | 2.172.236         | 0,77                         |
|   |                          |         |                   |                              |                                       |                          |         |                   |                              |
|   |                          |         |                   |                              |                                       | 1.410.000                | MXN     | 7.918.851         | 2,82                         |
|   |                          |         |                   |                              |                                       |                          |         |                   |                              |
|   |                          |         |                   |                              |                                       |                          |         |                   |                              |
|   |                          |         |                   |                              |                                       | 394.000                  | MXN     | 2.355.188         | 0,84                         |
|   |                          |         |                   |                              |                                       |                          |         | <b>37.809.133</b> | <b>13,45</b>                 |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Emerging Markets ESG Local Debt (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung                              | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|--|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|
| <b>PERU</b>                               |                          |         |                   |                              | <b>USA</b>   |                          |         |                   |                              |
| PERU (GOVT) 5,4 %<br>12/08/2034           | 6.500.000                | PEN     | 1.509.061         | 0,54                         | INTERNATIONAL BANK FOR RECON-<br>STRUCTION 4,5 % 15.04.2026                      | 16.000.000.000           | IDR     | 980.588           | 0,35                         |
| PERU (GOVT) 6,85 %<br>12/02/2042          | 200.000                  | PEN     | 51.383            | 0,02                         | INTERNATIONAL BANK FOR RECON-<br>STRUCTION 4,6 % 09.02.26                        | 32.000.000.000           | IDR     | 1.963.456         | 0,70                         |
| PERU (GOVT) 6,9 %<br>12/08/2037           | 6.200.000                | PEN     | 1.591.297         | 0,56                         | INTERNATIONAL BANK FOR RECON-<br>STRUCTION 4,75 % 21.01.27                       | 37.000.000.000           | IDR     | 2.254.383         | 0,80                         |
|   |                          |         | <b>3.151.741</b>  | <b>1,12</b>                  | INTERNATIONAL BANK FOR RECON-<br>STRUCTION 5,35 % 09.02.29                       | 63.000.000.000           | IDR     | 3.848.870         | 1,37                         |
| <b>PHILIPPINEN</b>                        |                          |         |                   |                              | <b>INTERNATIONAL BANK FOR RECON-<br/>STRUCTION 6,25 % 12.01.28</b>               |                          |         |                   |                              |
| ASIAN DEVELOPMENT BANK<br>6,55 % 26.01.25 | 76.000.000               | ZAR     | 3.938.986         | 1,40                         | INTERNATIONAL BANK FOR RECON-<br>STRUCTION 6,25 % 19.01.29                       | 60.000.000.000           | IDR     | 3.802.748         | 1,35                         |
|   |                          |         | <b>3.938.986</b>  | <b>1,40</b>                  | INTERNATIONAL BANK FOR RECON-<br>STRUCTION 6,25 % 21.01.27                       | 24.000.000               | ZAR     | 1.201.223         | 0,43                         |
| <b>POLEN</b>                              |                          |         |                   |                              | <b>INTERNATIONAL BANK FOR RECON-<br/>STRUCTION 6,5 % 08.12.27</b>                |                          |         |                   |                              |
| POLAND (GOVT) 0,25 %<br>25.10.26          | 28.200.000               | PLN     | 6.259.055         | 2,23                         | INTERNATIONAL BANK FOR RECON-<br>STRUCTION 6,5 % 08.12.27                        | 26.000.000.000           | IDR     | 1.670.476         | 0,59                         |
| POLAND (GOVT) 1,75 %<br>25.04.32          | 33.200.000               | PLN     | 6.387.941         | 2,27                         |  |                          |         | <b>19.142.808</b> | <b>6,81</b>                  |
| POLAND (GOVT) 2,5 %<br>25.07.26           | 18.000.000               | PLN     | 4.262.696         | 1,52                         | <b>URUGUAY</b>   |                          |         |                   |                              |
| POLAND (GOVT) 2,75 %<br>25.10.29          | 9.700.000                | PLN     | 2.145.948         | 0,76                         | URUGUAY (GOVT) 9,75 %<br>20.07.33  | 15.000.000               | UYU     | 418.827           | 0,15                         |
|   |                          |         | <b>19.055.640</b> | <b>6,78</b>                  |  |                          |         | <b>418.827</b>    | <b>0,15</b>                  |
| <b>RUMÄNIEN</b>                           |                          |         |                   |                              | <b>SUMME ANLEIHEN</b>  |                          |         |                   |                              |
| ROMANIA (GOVT) 3,65 %<br>24.09.31         | 23.700.000               | RON     | 4.319.289         | 1,54                         | <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN<br/>BÖRSE NOTIERTEN WERTPAPIERE</b>              |                          |         |                   |                              |
| ROMANIA (GOVT) 4,75 %<br>24.02.25         | 9.500.000                | RON     | 2.041.783         | 0,73                         | <b>224.568.733 79,89</b>   |                          |         |                   |                              |
| ROMANIA (GOVT) 5,8 %<br>26.07.27          | 36.900.000               | RON     | 7.938.080         | 2,82                         | <b>AN EINEM ANDEREM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE, ÜBERTRAGBARE<br/>WERTPAPIERE</b> |                          |         |                   |                              |
|   |                          |         | <b>14.299.152</b> | <b>5,09</b>                  | <b>ANLEIHEN</b>  |                          |         |                   |                              |
| <b>SÜDAFRIKA</b>                          |                          |         |                   |                              | <b>BRASILIEN</b>   |                          |         |                   |                              |
| SOUTH AFRICA (GOVT)<br>8,5 % 31.01.37     | 108.200.000              | ZAR     | 4.222.458         | 1,50                         | BRAZIL (GOVT) 10 %<br>01/01/2025   | 22.500                   | BRL     | 4.495.453         | 1,60                         |
| SOUTH AFRICA (GOVT)<br>8,75 % 28.02.48    | 86.200.000               | ZAR     | 3.158.665         | 1,12                         |  |                          |         | <b>4.495.453</b>  | <b>1,60</b>                  |
| SOUTH AFRICA (GOVT) 9 %<br>31.01.40       | 194.300.000              | ZAR     | 7.581.226         | 2,70                         | <b>TSCHECHISCHE REPUBLIK</b>   |                          |         |                   |                              |
|   |                          |         | <b>14.962.349</b> | <b>5,32</b>                  | CZECH (GOVT) 1 %<br>26.06.26   | 116.000.000              | CZK     | 4.657.950         | 1,66                         |
| <b>THAILAND</b>                           |                          |         |                   |                              | CZECH (GOVT) 1,5 %<br>24.04.40   | 6.460.000                | CZK     | 194.522           | 0,07                         |
| THAILAND (GOVT) 1,585 %<br>17.12.35       | 403.800.000              | THB     | 9.952.013         | 3,54                         | CZECH (GOVT) 1,75 %<br>23.06.32  | 154.300.000              | CZK     | 5.602.912         | 1,98                         |
| THAILAND (GOVT) 2,875 %<br>17.06.46       | 15.000.000               | THB     | 400.192           | 0,14                         | CZECH (GOVT) 2,75 %<br>23.07.29  | 125.000.000              | CZK     | 5.089.085         | 1,81                         |
| THAILAND (GOVT) 3,3 %<br>17.06.38         | 31.000.000               | THB     | 905.010           | 0,32                         | CZECH (GOVT) 4,2 %<br>04/12/2036   | 54.000.000               | CZK     | 2.357.322         | 0,84                         |
|   |                          |         | <b>11.257.215</b> | <b>4,00</b>                  | CZECH REPUBLIC (GOVT)<br>0,25 % 10.02.27   | 50.000.000               | CZK     | 1.938.737         | 0,69                         |
| <b>TÜRKEI</b>                             |                          |         |                   |                              |  |                          |         | <b>19.840.528</b> | <b>7,05</b>                  |
| TURKEY (GOVT) 10,5 %<br>11/08/2027        | 48.800.000               | TRY     | 921.140           | 0,32                         | <b>ANLEIHEN</b>  |                          |         |                   |                              |
| TURKEY (GOVT) 16,9 %<br>02/09/2026        | 24.000.000               | TRY     | 520.875           | 0,19                         | <b>BRASILIEN</b>   |                          |         |                   |                              |
|   |                          |         | <b>1.442.015</b>  | <b>0,51</b>                  | BRAZIL (GOVT) 10 %<br>01/01/2025   | 22.500                   | BRL     | 4.495.453         | 1,60                         |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Emerging Markets ESG Local Debt (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung                                       | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung                                   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung          | Kurswert    | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|--|--------------------------|------------------|-------------|------------------------------|
| <b>DOMINIKANISCHE REPUBLIK</b>                     |                          |         |                   |                              | <b>SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>       |                          |                  |             |                              |
| DOMINIC (GOVT) 9,75 %                              |                          |         |                   |                              | <b>ANLEIHEN</b>                                |                          |                  |             |                              |
| 05/06/2026   | 14.850.000               | DOP     | 252.167           | 0,09                         | MALAYSIA                                       |                          |                  |             |                              |
|  |                          |         | <b>252.167</b>    | <b>0,09</b>                  | MALAYSIA (GOVT) 3,955 %                        |                          |                  |             |                              |
| <b>MALAYSIA</b>                                    |                          |         |                   |                              | 15.09.25                                       |                          |                  |             |                              |
| MALAYSIA (GOVT) 3,757 %                            | 22.700.000               | MYR     | 4.662.572         | 1,66                         | 9.100.000                                      | MYR                      | 1.940.395        | 0,69        |                              |
| 22.05.40   |                          |         | <b>4.662.572</b>  | <b>1,66</b>                  |  |                          | <b>1.940.395</b> | <b>0,69</b> |                              |
| <b>PERU</b>  |                          |         |                   |                              | <b>PERU</b>                                    |                          |                  |             |                              |
| PERU (GOVT) 6,95 %                                 |                          |         |                   |                              | PERU (GOVT) 6,35 %                             |                          |                  |             |                              |
| 12/08/2031   | 6.900.000                | PEN     | 1.865.075         | 0,66                         | 12/08/2028                                     | 5.193.000                | PEN              | 1.432.168   | 0,51                         |
|  |                          |         | <b>1.865.075</b>  | <b>0,66</b>                  | PERU (GOVT) 7,3 %                              |                          |                  |             |                              |
| <b>RUMÄNIEN</b>                                    |                          |         |                   |                              | 12/08/2033                                     |                          |                  |             |                              |
| ROMANIA (GOVT) 4,75 %                              |                          |         |                   |                              | PERU (GOVT) 8,2 %                              |                          |                  |             |                              |
| 11/10/2034   | 7.100.000                | RON     | 1.337.249         | 0,48                         | 12/08/2026                                     | 913.000                  | PEN              | 260.915     | 0,09                         |
|  |                          |         | <b>1.337.249</b>  | <b>0,48</b>                  |  |                          | <b>2.950.311</b> | <b>1,05</b> |                              |
| <b>SÜDAFRIKA</b>                                   |                          |         |                   |                              | <b>POLEN</b>                                   |                          |                  |             |                              |
| SOUTH AFRICA (GOVT)                                |                          |         |                   |                              | POLAND (GOVT) 2,5 %                            |                          |                  |             |                              |
| 8,875 % 28.02.35                                   | 55.873.000               | ZAR     | 2.355.062         | 0,84                         | 25.07.27                                       | 11.100.000               | PLN              | 2.563.732   | 0,91                         |
|  |                          |         | <b>2.355.062</b>  | <b>0,84</b>                  |  |                          | <b>2.563.732</b> | <b>0,91</b> |                              |
| <b>URUGUAY</b>                                     |                          |         |                   |                              | <b>THAILAND</b>                                |                          |                  |             |                              |
| URUGUAY (GOVT) 8,25 %                              |                          |         |                   |                              | THAILAND (GOVT) 3,39 %                         |                          |                  |             |                              |
| 21.05.31   | 22.600.000               | UYU     | 577.120           | 0,21                         | 17.06.37                                       | 85.000.000               | THB              | 2.508.916   | 0,89                         |
|  |                          |         | <b>577.120</b>    | <b>0,21</b>                  |  |                          | <b>2.508.916</b> | <b>0,89</b> |                              |
| <b>SUMME ANLEIHEN</b>                              |                          |         |                   |                              | <b>SUMME ANLEIHEN</b>                          |                          |                  |             |                              |
| <b>SUMME DER AN EINER GEREGELTEN</b>               |                          |         |                   |                              | <b>SUMME SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |                          |                  |             |                              |
| <b>MARKT GEHANDELTEN ÜBERTRAGBAREN WERTPAPIERE</b> |                          |         |                   |                              | <b>SUMME WERTPAPIERANLAGEN</b>                 |                          |                  |             |                              |
|  |                          |         | <b>35.385.226</b> | <b>12,59</b>                 | <b>SONSTIGES NETTOVERMÖGEN</b>                 |                          |                  |             |                              |
| <b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>           |                          |         |                   |                              | <b>GESAMTNETTOVERMÖGEN</b>                     |                          |                  |             |                              |
| <b>IRLAND</b>                                      |                          |         |                   |                              | 281.103.263                                    |                          |                  |             |                              |
| HSBC GLOBAL LIQUIDITY                              |                          |         |                   |                              | 100,00   |                          |                  |             |                              |
| FUND   | 2                        | USD     | 2                 | 0,00                         |  |                          |                  |             |                              |
|  |                          |         | <b>2</b>          | <b>0,00</b>                  |  |                          |                  |             |                              |
| <b>SUMME ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>     |                          |         |                   |                              |  |                          |                  |             |                              |
|  |                          |         | <b>2</b>          | <b>0,00</b>                  |  |                          |                  |             |                              |
| <b>GELDMARKTINSTRUMENTE</b>                        |                          |         |                   |                              |  |                          |                  |             |                              |
| <b>SCHATZWECHSEL</b>                               |                          |         |                   |                              |  |                          |                  |             |                              |
| <b>USA</b>   |                          |         |                   |                              |  |                          |                  |             |                              |
| US (GOVT) 0 % 13.06.24                             | 4.400.000                | USD     | 4.353.509         | 1,55                         |  |                          |                  |             |                              |
| US (GOVT) 0 % 11.07.24                             | 1.200.000                | USD     | 1.182.697         | 0,42                         |  |                          |                  |             |                              |
| US (GOVT) 0 % 15.08.24                             | 500.000                  | USD     | 490.378           | 0,17                         |  |                          |                  |             |                              |
|  |                          |         | <b>6.026.584</b>  | <b>2,14</b>                  |  |                          |                  |             |                              |
| <b>SUMME SCHATZWECHSEL</b>                         |                          |         |                   |                              |  |                          |                  |             |                              |
| <b>GELDMARKTINSTRUMENTE GESAMT</b>                 |                          |         |                   |                              |  |                          |                  |             |                              |
|  |                          |         | <b>6.026.584</b>  | <b>2,14</b>                  |  |                          |                  |             |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Emerging Markets Local Debt

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung                 | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--------------------------|---------|----------|------------------------------|------------------------------|--------------------------|---------|----------|------------------------------|
| <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>   |                          |         |          |                              | <b>HUNGARY (GOVT) 4,75 %</b> |                          |         |          |                              |
| <b>AN EINER GEREGELTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |                          |         |          |                              | 24.11.32                     |                          |         |          |                              |
| <b>ANLEIHEN</b>  |                          |         |          |                              | 2.103.200.000                |                          |         |          |                              |
| <b>BRASILIEN</b>   |                          |         |          |                              | HUF                          |                          |         |          |                              |
| BRAZIL (GOVT) 0 %  |                          |         |          |                              | 5.047.862                    |                          |         |          |                              |
| 01/07/2024   |                          |         |          |                              | 0,55                         |                          |         |          |                              |
| BRAZIL (GOVT) 10 %   |                          |         |          |                              | <b>9.447.716</b>             |                          |         |          |                              |
| 01/01/2029   |                          |         |          |                              | <b>1,03</b>                  |                          |         |          |                              |
| BRAZIL (GOVT) 10 %   |                          |         |          |                              | <b>INDONESIEN</b>            |                          |         |          |                              |
| 01/01/2031   |                          |         |          |                              | INDONESIA (GOVT) 6,5 %       |                          |         |          |                              |
| BRAZIL (GOVT) 10 %   |                          |         |          |                              | 15.02.31                     |                          |         |          |                              |
| 01/01/2033   |                          |         |          |                              | 101.300.000.000              |                          |         |          |                              |
| BRAZIL LETRAS DO TESOURO   |                          |         |          |                              | 15.02.33                     |                          |         |          |                              |
| NACIONAL 0 % 1.10.2024   |                          |         |          |                              | 143.500.000.000              |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 15.06.35                     |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 287.680.000.000              |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 15.05.38                     |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 96.000.000.000               |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | IDR                          |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 6.404.774                    |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 0,70                         |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | <b>41.235.724</b>            |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | <b>4,49</b>                  |                          |         |          |                              |
| <b>CHILE</b>   |                          |         |          |                              | <b>MALAYSIA</b>              |                          |         |          |                              |
| BONOS DE LA TESORERIA DE   |                          |         |          |                              | MALAYSIA (GOVT) 2,632 %      |                          |         |          |                              |
| LA REPUBLIC 6 % 01.04.2033   |                          |         |          |                              | 15.04.31                     |                          |         |          |                              |
| CHILE (GOVT) 4,5 %   |                          |         |          |                              | 40.000.000                   |                          |         |          |                              |
| 01/03/2026   |                          |         |          |                              | MYR                          |                          |         |          |                              |
| CHILE (GOVT) 4,7 %   |                          |         |          |                              | 7.870.920                    |                          |         |          |                              |
| 01/09/2030   |                          |         |          |                              | 0,86                         |                          |         |          |                              |
| CHILE (GOVT) 5 %   |                          |         |          |                              | MALAYSIA (GOVT) 3,885 %      |                          |         |          |                              |
| 01/03/2035   |                          |         |          |                              | 15.08.29                     |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 33.400.000                   |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | MYR                          |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 7.146.007                    |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 0,78                         |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | MALAYSIA (GOVT) 3,9 %        |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 30.11.26                     |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 37.100.000                   |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | MYR                          |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 7.936.677                    |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 0,86                         |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | MALAYSIA (GOVT) 4,065 %      |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 15.06.50                     |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 13.100.000                   |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | MYR                          |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 2.721.936                    |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 0,30                         |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | MALAYSIA (GOVT) 4,254 %      |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 31.05.35                     |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 22.640.000                   |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | MYR                          |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 4.938.696                    |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 0,54                         |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | <b>30.614.236</b>            |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | <b>3,34</b>                  |                          |         |          |                              |
| <b>KOLUMBIEN</b>   |                          |         |          |                              | <b>MEXIKO</b>                |                          |         |          |                              |
| COLOMBIA (GOVT) 7,25 %   |                          |         |          |                              | MEX BONOS DESARR 5,75 %      |                          |         |          |                              |
| 18.10.34   |                          |         |          |                              | 05/03/2026                   |                          |         |          |                              |
| 15.900.000.000   |                          |         |          |                              | 700.000                      |                          |         |          |                              |
| COP  |                          |         |          |                              | MXN                          |                          |         |          |                              |
| 3.370.902  |                          |         |          |                              | 3.898.521                    |                          |         |          |                              |
| 0,37   |                          |         |          |                              | 0,42                         |                          |         |          |                              |
| COLOMBIA (GOVT) 7,25 %   |                          |         |          |                              | MEXICO (GOVT) 5 %            |                          |         |          |                              |
| 26.10.50   |                          |         |          |                              | 06/03/2025                   |                          |         |          |                              |
| 16.000.000.000   |                          |         |          |                              | 2.900.000                    |                          |         |          |                              |
| COP  |                          |         |          |                              | MXN                          |                          |         |          |                              |
| 2.922.699  |                          |         |          |                              | 16.601.748                   |                          |         |          |                              |
| 0,32   |                          |         |          |                              | 1,81                         |                          |         |          |                              |
| TITULOS DE TESORERIA B   |                          |         |          |                              | MEXICO (GOVT) 7,5 %          |                          |         |          |                              |
| 7,5 % 26.08.26   |                          |         |          |                              | 03/06/2027                   |                          |         |          |                              |
| 23.624.600.000   |                          |         |          |                              | 3.020.000                    |                          |         |          |                              |
| COP  |                          |         |          |                              | MXN                          |                          |         |          |                              |
| 5.904.281  |                          |         |          |                              | 17.205.116                   |                          |         |          |                              |
| 0,64   |                          |         |          |                              | 1,87                         |                          |         |          |                              |
| TITULOS DE TESORERIA B   |                          |         |          |                              | MEXICO (GOVT) 7,5 %          |                          |         |          |                              |
| 7,75 % 18.09.30  |                          |         |          |                              | 26.05.33                     |                          |         |          |                              |
| 41.662.200.000   |                          |         |          |                              | 1.325.000                    |                          |         |          |                              |
| COP  |                          |         |          |                              | MXN                          |                          |         |          |                              |
| 9.846.572  |                          |         |          |                              | 7.127.183                    |                          |         |          |                              |
| 1,07   |                          |         |          |                              | 0,78                         |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | MEXICO (GOVT) 7,75 %         |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 13.11.42                     |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 88.000                       |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | MXN                          |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 451.990                      |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 0,05                         |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | MEXICO (GOVT) 8,5 %          |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 31.05.29                     |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 1.000.000                    |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | MXN                          |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 5.833.073                    |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 0,64                         |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | MEXICO (GOVT) 8,5 %          |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 18.11.38                     |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 4.022.000                    |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | MXN                          |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 22.588.381                   |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 2,46                         |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | MEXICO (GOVT) 10 %           |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 05/12/2024                   |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 9.700                        |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | MXN                          |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 57.983                       |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 0,01                         |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | <b>73.763.995</b>            |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | <b>8,04</b>                  |                          |         |          |                              |
| <b>DOMINIKANISCHE REPUBLIK</b>                                     |                          |         |          |                              | <b>PERU</b>                  |                          |         |          |                              |
| DOMINICAN (GOVT) 11,25 %   |                          |         |          |                              | PERU (GOVT) 5,4 %            |                          |         |          |                              |
| 15.09.35   |                          |         |          |                              | 12/08/2034                   |                          |         |          |                              |
| 11.300.000   |                          |         |          |                              | 20.600.000                   |                          |         |          |                              |
| DOP  |                          |         |          |                              | PEN                          |                          |         |          |                              |
| 206.819  |                          |         |          |                              | 4.782.564                    |                          |         |          |                              |
| 0,02   |                          |         |          |                              | 0,52                         |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | PERU (GOVT) 6,85 %           |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 12/02/2042                   |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 4.325.000                    |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | PEN                          |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 1.111.151                    |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 0,12                         |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | PERU (GOVT) 6,9 %            |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 12/08/2037                   |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 11.700.000                   |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | PEN                          |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 3.002.931                    |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 0,33                         |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | <b>8.896.646</b>             |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | <b>0,97</b>                  |                          |         |          |                              |
| <b>UNGARN</b>  |                          |         |          |                              |                              |                          |         |          |                              |
| HUNGARY (GOVT) 3 %   |                          |         |          |                              |                              |                          |         |          |                              |
| 21.08.30   |                          |         |          |                              |                              |                          |         |          |                              |
| 1.282.000.000  |                          |         |          |                              |                              |                          |         |          |                              |
| HUF  |                          |         |          |                              |                              |                          |         |          |                              |
| 2.858.770  |                          |         |          |                              |                              |                          |         |          |                              |
| 0,31   |                          |         |          |                              |                              |                          |         |          |                              |
| HUNGARY (GOVT) 4,5 %   |                          |         |          |                              |                              |                          |         |          |                              |
| 27.05.32   |                          |         |          |                              |                              |                          |         |          |                              |
| 650.000.000  |                          |         |          |                              |                              |                          |         |          |                              |
| HUF  |                          |         |          |                              |                              |                          |         |          |                              |
| 1.541.084  |                          |         |          |                              |                              |                          |         |          |                              |
| 0,17   |                          |         |          |                              |                              |                          |         |          |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Emerging Markets Local Debt (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|--------------------|------------------------------|---|--------------------------|---------|--------------------|------------------------------|
| <b>POLEN</b>  |                          |         |                    |                              | <b>TSCHECHISCHE REPUBLIK</b>  |                          |         |                    |                              |
| POLAND (GOVT) 0,25 %<br>25.10.26  | 77.000.000               | PLN     | 17.090.328         | 1,86                         | CZECH (GOVT) 1,75 %<br>23.06.32   | 145.400.000              | CZK     | 5.279.737          | 0,57                         |
| POLAND (GOVT) 1,75 %<br>25.04.32  | 35.100.000               | PLN     | 6.753.516          | 0,74                         | CZECH (GOVT) 4,2 %<br>04/12/2036  | 66.400.000               | CZK     | 2.898.633          | 0,32                         |
| POLAND (GOVT) 2,75 %<br>25.10.29  | 13.000.000               | PLN     | 2.876.012          | 0,31                         |   |                          |         | <b>8.178.370</b>   | <b>0,89</b>                  |
| POLAND (GOVT) 3,25 %<br>25.07.25  | 56.300.000               | PLN     | 13.780.616         | 1,50                         | <b>DOMINIKANISCHE REPUBLIK</b>  |                          |         |                    |                              |
|   |                          |         | <b>40.500.472</b>  | <b>4,41</b>                  | DOMINIC (GOVT) 9,75 %<br>05/06/2026   | 100.800.000              | DOP     | 1.711.678          | 0,19                         |
| <b>RUMÄNIEN</b>   |                          |         |                    |                              |   |                          |         | <b>1.711.678</b>   | <b>0,19</b>                  |
| ROMANIA (GOVT) 3,65 %<br>24.09.31   | 24.500.000               | RON     | 4.465.088          | 0,49                         | <b>MALAYSIA</b>   |                          |         |                    |                              |
| ROMANIA (GOVT) 5,8 %<br>26.07.27  | 83.300.000               | RON     | 17.919.839         | 1,95                         | MALAYSIA (GOVT) 3,757 %<br>22.05.40   | 27.500.000               | MYR     | 5.648.490          | 0,62                         |
|   |                          |         | <b>22.384.927</b>  | <b>2,44</b>                  |   |                          |         | <b>5.648.490</b>   | <b>0,62</b>                  |
| <b>SÜDAFRIKA</b>  |                          |         |                    |                              | <b>PERU</b>   |                          |         |                    |                              |
| SOUTH AFRICA (GOVT)<br>6,25 % 31.03.36  | 390.700.000              | ZAR     | 12.853.950         | 1,40                         | PERU (GOVT) 6,95 %<br>12/08/2031  | 17.094.000               | PEN     | 4.620.521          | 0,50                         |
| SOUTH AFRICA (GOVT) 9 %<br>31.01.40   | 398.600.000              | ZAR     | 15.552.635         | 1,70                         |   |                          |         | <b>4.620.521</b>   | <b>0,50</b>                  |
| SOUTH AFRICA (GOVT)<br>10,5 % 21.12.26  | 100.000.000              | ZAR     | 5.431.531          | 0,59                         | <b>SÜDAFRIKA</b>  |                          |         |                    |                              |
|   |                          |         | <b>33.838.116</b>  | <b>3,69</b>                  | SOUTH AFRICA (GOVT)<br>8,875 % 28.02.35   | 87.000.000               | ZAR     | 3.667.074          | 0,40                         |
| <b>THAILAND</b>   |                          |         |                    |                              |   |                          |         | <b>3.667.074</b>   | <b>0,40</b>                  |
| THAILAND (GOVT) 1,585 %<br>17.12.35   | 422.000.000              | THB     | 10.400.568         | 1,13                         | <b>URUGUAY</b>  |                          |         |                    |                              |
| THAILAND (GOVT) 3,3 %<br>17.06.38   | 386.750.000              | THB     | 11.290.732         | 1,23                         | URUGUAY (GOVT) 8,25 %<br>21.05.31   | 26.500.000               | UYU     | 676.711            | 0,07                         |
|   |                          |         | <b>21.691.300</b>  | <b>2,36</b>                  |   |                          |         | <b>676.711</b>     | <b>0,07</b>                  |
| <b>TÜRKEI</b>   |                          |         |                    |                              | <b>SUMME ANLEIHEN</b>   |                          |         | <b>33.693.548</b>  | <b>3,67</b>                  |
| TURKEY (GOVT) 10,5 %<br>11/08/2027  | 130.600.000              | TRY     | 2.465.183          | 0,27                         | <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN<br/>MARKT GEHANDELTEN ÜBERTRAGBAREN WERTPAPIERE</b> |                          |         | <b>33.693.548</b>  | <b>3,67</b>                  |
| TURKEY (GOVT) 16,9 %<br>02/09/2026  | 55.400.000               | TRY     | 1.202.353          | 0,13                         | <b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>  |                          |         |                    |                              |
|   |                          |         | <b>3.667.536</b>   | <b>0,40</b>                  | <b>IRLAND</b>   |                          |         |                    |                              |
| <b>SUMME ANLEIHEN</b>   |                          |         | <b>425.081.472</b> | <b>46,31</b>                 | HSBC GLOBAL LIQUIDITY<br>FUND   | 74.117.806               | USD     | 74.117.806         | 8,07                         |
| <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN<br/>BÖRSE NOTIERTEN WERTPAPIERE<br/>WERTPAPIERE</b> |                          |         | <b>425.081.472</b> | <b>46,31</b>                 |   |                          |         | <b>74.117.806</b>  | <b>8,07</b>                  |
| <b>AN EINEM ANDEREM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE, ÜBERTRAGBARE<br/>WERTPAPIERE</b>    |                          |         |                    |                              | <b>SUMME ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>                                      |                          |         | <b>74.117.806</b>  | <b>8,07</b>                  |
| <b>ANLEIHEN</b>   |                          |         |                    |                              | <b>GELDMARKTINSTRUMENTE</b>   |                          |         |                    |                              |
| <b>BRASILIEN</b>  |                          |         |                    |                              | <b>SCHATZWECHSEL</b>  |                          |         |                    |                              |
| BRAZIL (GOVT) 10 %<br>01/01/2025  | 46.000                   | BRL     | 9.190.704          | 1,00                         | <b>USA</b>  |                          |         |                    |                              |
|   |                          |         | <b>9.190.704</b>   | <b>1,00</b>                  | US (GOVT) 0 % 04.04.24  | 91.500.000               | USD     | 91.460.734         | 9,95                         |
|   |                          |         |                    |                              | US (GOVT) 0 % 16.05.24  | 80.200.000               | USD     | 79.678.168         | 8,68                         |
|   |                          |         |                    |                              | US (GOVT) 0 % 13.06.24  | 67.700.000               | USD     | 66.984.673         | 7,30                         |
|   |                          |         |                    |                              | US (GOVT) 0 % 11.07.24  | 86.500.000               | USD     | 85.252.776         | 9,29                         |
|   |                          |         |                    |                              | US (GOVT) 0 % 15.08.24  | 42.500.000               | USD     | 41.682.110         | 4,54                         |
|   |                          |         |                    |                              |   |                          |         | <b>365.058.461</b> | <b>39,76</b>                 |
|   |                          |         |                    |                              | <b>SUMME SCHATZWECHSEL</b>  |                          |         | <b>365.058.461</b> | <b>39,76</b>                 |
|   |                          |         |                    |                              | <b>GELDMARKTINSTRUMENTE GESAMT</b>  |                          |         | <b>365.058.461</b> | <b>39,76</b>                 |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Emerging Markets Local Debt (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung                                   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--------------------------|---------|--------------------|------------------------------|
| <b>SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>       |                          |         |                    |                              |
| <b>ANLEIHEN</b>                                |                          |         |                    |                              |
| <b>MALAYSIA</b>                                |                          |         |                    |                              |
| MALAYSIA (GOVT) 3,828 %<br>05/07/2034          | 15.000.000               | MYR     | 3.167.851          | 0,35                         |
| MALAYSIA (GOVT) 3,955 %<br>15.09.25            | 38.470.000               | MYR     | 8.202.966          | 0,88                         |
|  |                          |         | <b>11.370.817</b>  | <b>1,23</b>                  |
| <b>PERU</b>                                    |                          |         |                    |                              |
| PERU (GOVT) 6,35 %<br>12/08/2028               | 11.300.000               | PEN     | 3.116.407          | 0,34                         |
|  |                          |         | <b>3.116.407</b>   | <b>0,34</b>                  |
| <b>POLEN</b>                                   |                          |         |                    |                              |
| POLAND (GOVT) 2,5 %<br>25.07.27                | 22.900.000               | PLN     | 5.289.142          | 0,58                         |
|  |                          |         | <b>5.289.142</b>   | <b>0,58</b>                  |
| <b>SUMME ANLEIHEN</b>                          |                          |         | <b>19.776.366</b>  | <b>2,15</b>                  |
| <b>SUMME SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |                          |         | <b>19.776.366</b>  | <b>2,15</b>                  |
| <b>SUMME WERTPAPIERANLAGEN</b>                 |                          |         | <b>917.727.653</b> | <b>99,96</b>                 |
| <b>SONSTIGES NETTOVERMÖGEN</b>                 |                          |         | <b>408.436</b>     | <b>0,04</b>                  |
| <b>GESAMTNETTOVERMÖGEN</b>                     |                          |         | <b>918.136.089</b> | <b>100,00</b>                |

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global ESG Corporate Bond

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung                                | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|------------------|------------------------------|---|--------------------------|---------|-----------|------------------------------|
| <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>                    |                          |         |                  |                              | <b>AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |                          |         |           |                              |
| <b>ANLEIHEN</b>                             |                          |         |                  |                              | <b>ANLEIHEN</b>   |                          |         |           |                              |
| <b>AUSTRALIEN</b>                           |                          |         |                  |                              | <b>AUSTRALIEN</b>   |                          |         |           |                              |
| SYDNEY AIRPORT FINANCE<br>2,75 % 23.04.24   | 370.000                  | EUR     | 399.388          | 0,22                         | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL<br>2,625 % 06.11.29            | 800.000                  | EUR     | 820.999   | 0,45                         |
|   |                          |         | <b>399.388</b>   | <b>0,22</b>                  | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL<br>3,875 % VRN 16.06.32        | 300.000                  | EUR     | 320.783   | 0,18                         |
| <b>BELGIEN</b>                              |                          |         |                  |                              | <b>BELGIEN</b>  |                          |         |           |                              |
| BELFIUS BANK 3,875 %<br>12/06/2028          | 100.000                  | EUR     | 110.329          | 0,06                         | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL<br>4,125 % 18.09.30            | 400.000                  | EUR     | 451.316   | 0,25                         |
| ELIA GROUP 5,85 % VRN PERP                  | 800.000                  | EUR     | 891.476          | 0,49                         | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL<br>4,375 % 11.01.34            | 500.000                  | EUR     | 537.093   | 0,30                         |
| ELIA TRANSMISSION                           |                          |         |                  |                              | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL<br>5,125 % 13.01.33            | 400.000                  | EUR     | 461.211   | 0,26                         |
| BELGIUM 3,75 % 16.01.2036                   | 200.000                  | EUR     | 218.683          | 0,12                         | BNP PARIBAS 2,5 % VRN<br>31.03.32                                 | 200.000                  | EUR     | 205.250   | 0,11                         |
| FLUVIUS SYSTEM OPERATOR<br>3,875 % 18.03.31 | 400.000                  | EUR     | 443.419          | 0,25                         | BNP PARIBAS 4,125 % VRN<br>26.09.32                               | 200.000                  | EUR     | 225.235   | 0,12                         |
| KBC GROUP 3,75 %<br>27.03.32                | 500.000                  | EUR     | 546.882          | 0,30                         | BNP PARIBAS 8 % VRN PERP<br>CARREFOUR 4,125 %<br>12/10/2028       | 205.000                  | USD     | 209.501   | 0,12                         |
|   |                          |         | <b>2.210.789</b> | <b>1,22</b>                  | CREDIT AGRICOLE 2 %<br>25.03.29                                   | 200.000                  | EUR     | 198.930   | 0,11                         |
| <b>KANADA</b>                               |                          |         |                  |                              | <b>KANADA</b>   |                          |         |           |                              |
| ALIMENTATION COUCHETARD<br>4,011 % 12.02.36 | 271.000                  | EUR     | 294.830          | 0,16                         | CREDIT AGRICOLE 3,875 %<br>20.04.31                               | 500.000                  | EUR     | 557.650   | 0,31                         |
| NUTRIEN 5,95 % 07.11.2025                   | 1.000.000                | USD     | 1.009.308        | 0,55                         | CREDIT AGRICOLE ASSURANCES<br>2,625 % VRN 29.01.48                | 500.000                  | EUR     | 507.734   | 0,28                         |
| ROYAL BANK OF CANADA<br>2,125 % 26.04.29    | 900.000                  | EUR     | 914.425          | 0,51                         | CREDIT MUTUEL ARKEA<br>3,875 % 22.05.28                           | 500.000                  | EUR     | 549.927   | 0,30                         |
| TORONTODOMINION BANK<br>1,707 % 28.07.25    | 800.000                  | EUR     | 845.291          | 0,47                         | DANONE 3,071 % 07.09.32   | 200.000                  | EUR     | 213.422   | 0,12                         |
| TORONTODOMINION BANK<br>5,156 % 10.01.28    | 1.000.000                | USD     | 1.007.765        | 0,56                         | DANONE 3,47 % 22.05.31  | 500.000                  | EUR     | 548.812   | 0,30                         |
|   |                          |         | <b>4.071.619</b> | <b>2,25</b>                  | EDENRED 3,625 % 13.06.2031  | 400.000                  | EUR     | 436.304   | 0,24                         |
| <b>DÄNEMARK</b>                             |                          |         |                  |                              | <b>DÄNEMARK</b>   |                          |         |           |                              |
| ISS GLOBAL 2,125 %<br>02/12/2024            | 100.000                  | EUR     | 106.663          | 0,06                         | ELECTRICITE DE FRANCE<br>1 % 29.11.33                             | 500.000                  | EUR     | 421.296   | 0,23                         |
| JYSKE BANK 0,05 %<br>VRN 02.09.26           | 1.000.000                | EUR     | 1.021.877        | 0,57                         | ELECTRICITE DE FRANCE<br>4,625 % 25.01.43                         | 300.000                  | EUR     | 338.638   | 0,19                         |
| JYSKE BANK 5,125 % VRN<br>01/05/2035        | 300.000                  | EUR     | 331.421          | 0,18                         | GECINA 0,875 % 25.01.33   | 400.000                  | EUR     | 350.024   | 0,19                         |
|   |                          |         | <b>1.459.961</b> | <b>0,81</b>                  | GECINA 1,625 % 14.03.30   | 500.000                  | EUR     | 490.239   | 0,27                         |
| <b>FINNLAND</b>                             |                          |         |                  |                              | <b>FINNLAND</b>   |                          |         |           |                              |
| NORDEA BANK 4,875 % VRN<br>23.02.34         | 251.000                  | EUR     | 280.433          | 0,16                         | KERING 3,375 % 27.02.33   | 700.000                  | EUR     | 754.315   | 0,42                         |
| SAMPO 2,5 % VRN 03.09.2052                  | 500.000                  | EUR     | 468.862          | 0,26                         | KERING 3,875 % 05.09.35   | 500.000                  | EUR     | 556.625   | 0,31                         |
| STORA ENSO 4,25 %<br>01/09/2029             | 600.000                  | EUR     | 664.505          | 0,36                         | LA POSTE 4 % 12.06.2035   | 500.000                  | EUR     | 571.161   | 0,32                         |
|   |                          |         | <b>1.413.800</b> | <b>0,78</b>                  | LOREAL 0,875 % 29.06.26   | 700.000                  | EUR     | 719.989   | 0,40                         |
| <b>FRANKREICH</b>                           |                          |         |                  |                              | <b>FRANKREICH</b>   |                          |         |           |                              |
| APRR 1,5 % 17.01.33                         | 100.000                  | EUR     | 93.301           | 0,05                         | LOREAL 3,125 % 19.05.25   | 500.000                  | EUR     | 538.141   | 0,30                         |
| AXA 6,375 % VRN PERP                        | 582.000                  | EUR     | 653.681          | 0,36                         | ORANGE 1,625 % 07.04.32   | 300.000                  | EUR     | 288.525   | 0,16                         |
|   |                          |         |                  |                              | ORANGE 2,375 % VRN PERP   | 300.000                  | EUR     | 319.136   | 0,18                         |
|   |                          |         |                  |                              | ORANO 4 % 12.03.31  | 600.000                  | EUR     | 651.426   | 0,36                         |
|   |                          |         |                  |                              | RCI BANQUE 4,125 %<br>01/12/2025                                  | 500.000                  | EUR     | 542.252   | 0,30                         |
|   |                          |         |                  |                              | RTE RESEAU DE TRANSPORT<br>0,75 % 12.01.34                        | 200.000                  | EUR     | 170.626   | 0,09                         |
|   |                          |         |                  |                              | SCHNEIDER ELECTRIC<br>3,375 % 06.04.25                            | 1.200.000                | EUR     | 1.293.994 | 0,72                         |
|   |                          |         |                  |                              | SOCIETE GENERALE 0,5 %<br>VRN 12.06.29                            | 700.000                  | EUR     | 660.912   | 0,37                         |
|   |                          |         |                  |                              | SOCIETE GENERALE 0,625 %<br>VRN 02.12.27                          | 300.000                  | EUR     | 298.568   | 0,17                         |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global ESG Corporate Bond (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung                 | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung                   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------------------------|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|--------------------------------|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|
| TOTAL 3,369 % VRN PERP       | 250.000                  | EUR     | 264.500           | 0,15                         | NATIONWIDE BUILDING SOCIETY    |                          |         |                   |                              |
| TOTAL CAPITAL 0,75 %         |                          |         |                   |                              | 3,96 % VRN 18.07.30            | 675.000                  | USD     | 625.601           | 0,35                         |
| 12/07/2028                   | 100.000                  | EUR     | 97.334            | 0,05                         | NATIONWIDE BUILDING SOCIETY    |                          |         |                   |                              |
| TOTAL ENERGIES 2 % VRN       |                          |         |                   |                              | 6,557 % VRN 18.10.27           | 330.000                  | USD     | 338.809           | 0,19                         |
| PERP                         | 734.000                  | EUR     | 740.775           | 0,41                         | NATWEST GROUP 0,78 % VRN       |                          |         |                   |                              |
| WPP FINANCE 2,25 %           |                          |         |                   |                              | 26.02.30                       | 800.000                  | EUR     | 755.137           | 0,42                         |
| 22.09.26                     | 500.000                  | EUR     | 526.154           | 0,29                         | NATWEST MARKETS 1,6 %          |                          |         |                   |                              |
|                              |                          |         | <b>18.143.704</b> | <b>10,05</b>                 | 29.09.26                       | 215.000                  | USD     | 196.789           | 0,11                         |
| <b>DEUTSCHLAND</b>           |                          |         |                   |                              | PRUDENTIAL FUNDING ASIA        |                          |         |                   |                              |
| DAIMLER 0,75 % 10.09.2030    | 500.000                  | EUR     | 471.057           | 0,26                         | 3,625 % 24.03.32               | 665.000                  | USD     | 601.045           | 0,33                         |
| DEUTSCHE BANK 3,75 % VRN     |                          |         |                   |                              | SANTANDER UK GROUP HOLDINGS    |                          |         |                   |                              |
| 15.01.30                     | 700.000                  | EUR     | 757.964           | 0,42                         | 2,469 % VRN 11.01.28           | 220.000                  | USD     | 202.260           | 0,11                         |
| DEUTSCHE BOERSE 2 % VRN      |                          |         |                   |                              | SSE 0,875 % 06.09.25           | 400.000                  | EUR     | 415.994           | 0,23                         |
| 23.06.48                     | 400.000                  | EUR     | 398.445           | 0,22                         | STANDARD CHARTERED             |                          |         |                   |                              |
| DEUTSCHE WOHNEN 1,5 %        |                          |         |                   |                              | 1,822 % 23.11.25               | 520.000                  | USD     | 505.954           | 0,28                         |
| 30.04.30                     | 700.000                  | EUR     | 661.516           | 0,37                         | STANDARD CHARTERED             |                          |         |                   |                              |
| EUROGRID 3,915 %             |                          |         |                   |                              | 4,196 % VRN 04.03.32           | 289.000                  | EUR     | 315.453           | 0,17                         |
| 01/02/2034                   | 200.000                  | EUR     | 220.620           | 0,12                         | STANDARD CHARTERED FRN         |                          |         |                   |                              |
| EUROGRID GMBH 1,5 %          |                          |         |                   |                              | 30.03.26                       | 1.330.000                | USD     | 1.343.072         | 0,74                         |
| 18.04.28                     | 600.000                  | EUR     | 600.335           | 0,33                         | TESCO CORPORATE TREASURY       |                          |         |                   |                              |
| MUENCHENER RUECKVERSICHERUNG |                          |         |                   |                              | SERVICE 4,25 % 27.02.2031      | 486.000                  | EUR     | 544.150           | 0,30                         |
| 3,25 % VRN 26.05.49          | 500.000                  | EUR     | 523.393           | 0,29                         | VODAFONE GROUP 2,2 %           |                          |         |                   |                              |
| TALANX 1,75 % VRN            |                          |         |                   |                              | 25.08.26                       | 530.000                  | EUR     | 558.490           | 0,31                         |
| 01/12/2042                   | 600.000                  | EUR     | 544.199           | 0,30                         | VODAFONE GROUP 2,875 %         |                          |         |                   |                              |
| VONOVIA 4,75 % 23.05.2027    | 400.000                  | EUR     | 443.738           | 0,25                         | 20.11.37                       | 300.000                  | EUR     | 298.908           | 0,17                         |
|                              |                          |         | <b>4.621.267</b>  | <b>2,56</b>                  | VODAFONE GROUP 4,875 %         |                          |         |                   |                              |
| <b>GROSSBRITANNIEN</b>       |                          |         |                   |                              | 19.06.49                       | 75.000                   | USD     | 67.288            | 0,04                         |
| BARCLAYS 2,852 % VRN         |                          |         |                   |                              | WPP FINANCE 4 % 12.09.2033     | 701.000                  | EUR     | 760.828           | 0,42                         |
| 07/05/2026                   | 250.000                  | USD     | 242.427           | 0,13                         |                                |                          |         | <b>15.244.068</b> | <b>8,44</b>                  |
| BARCLAYS 4,506 % VRN         |                          |         |                   |                              | <b>IRELAND</b>                 |                          |         |                   |                              |
| 31.01.33                     | 421.000                  | EUR     | 466.762           | 0,26                         | AIB GROUP 5,25 % VRN           |                          |         |                   |                              |
| BARCLAYS 5,262 % VRN         |                          |         |                   |                              | 23.10.31                       | 400.000                  | EUR     | 467.009           | 0,26                         |
| 29.01.34                     | 800.000                  | EUR     | 934.542           | 0,52                         | JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL |                          |         |                   |                              |
| BARCLAYS 6,692 % VRN         |                          |         |                   |                              | 3,625 % 02.07.24               | 415.000                  | USD     | 412.770           | 0,23                         |
| 13.09.34                     | 305.000                  | USD     | 325.628           | 0,18                         |                                |                          |         | <b>879.779</b>    | <b>0,49</b>                  |
| BARCLAYS 7,325 % VRN         |                          |         |                   |                              | <b>ITALIEN</b>                 |                          |         |                   |                              |
| 02/11/2026                   | 840.000                  | USD     | 860.841           | 0,48                         | ASSICURAZIONI GENERALI         |                          |         |                   |                              |
| BP CAPITAL MARKETS           |                          |         |                   |                              | 5,272 % 12.09.33               | 512.000                  | EUR     | 588.726           | 0,33                         |
| 3,25 % VRN PERP              | 500.000                  | EUR     | 526.847           | 0,29                         | SNAM 4 % 27.11.29              | 348.000                  | EUR     | 385.765           | 0,21                         |
| BP CAPITAL MARKETS           |                          |         |                   |                              | TERNA RETE ELETTRICA NAZIONALE |                          |         |                   |                              |
| 3,625 % VRN PERP             | 400.000                  | EUR     | 413.096           | 0,23                         | 3,625 % 21.04.29               | 300.000                  | EUR     | 327.403           | 0,18                         |
| HSBC HOLDINGS 4,599 %        |                          |         |                   |                              | UNICREDIT 4 % 05.03.2034       | 700.000                  | EUR     | 767.207           | 0,43                         |
| VRN 22.03.35                 | 881.000                  | EUR     | 960.734           | 0,53                         | UNICREDIT 4,3 % VRN            |                          |         |                   |                              |
| LLOYDS BANKING 3,574 %       |                          |         |                   |                              | 23.01.31                       | 500.000                  | EUR     | 549.108           | 0,30                         |
| VRN 07.11.28                 | 425.000                  | USD     | 399.094           | 0,22                         |                                |                          |         | <b>2.618.209</b>  | <b>1,45</b>                  |
| LLOYDS BANKING 3,75 %        |                          |         |                   |                              | <b>JAPAN</b>                   |                          |         |                   |                              |
| VRN 18.03.28                 | 1.000.000                | USD     | 958.533           | 0,53                         | TAKEDA PHARMACEUTICAL          |                          |         |                   |                              |
| LLOYDS BANKING GROUP         |                          |         |                   |                              | 1 % 09.07.29                   | 400.000                  | EUR     | 384.703           | 0,21                         |
| 4,45 % 08.05.25              | 250.000                  | USD     | 247.070           | 0,14                         | TAKEDA PHARMACEUTICAL          |                          |         |                   |                              |
| NATIONAL GRID 3,875 %        |                          |         |                   |                              | 3 % 21.11.30                   | 560.000                  | EUR     | 591.716           | 0,33                         |
| 16.01.29                     | 611.000                  | EUR     | 672.028           | 0,37                         |                                |                          |         | <b>976.419</b>    | <b>0,54</b>                  |
| NATIONAL GRID 5,418 %        |                          |         |                   |                              |                                |                          |         |                   |                              |
| 11/01/2034                   | 710.000                  | USD     | 706.688           | 0,39                         |                                |                          |         |                   |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global ESG Corporate Bond (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung                      | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung                    | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|-----------------------------------|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|---------------------------------|--------------------------|---------|------------------|------------------------------|
| <b>LUXEMBURG</b>                  |                          |         |                   |                              | <b>NORWEGEN</b>                 |                          |         |                  |                              |
| PROLOGIS INTERNATIONAL            |                          |         |                   |                              | DNB BANK 4,625 % VRN            |                          |         |                  |                              |
| FUNDING 4,625 % 21.02.35          | 354.000                  | EUR     | 401.931           | 0,22                         | 28.02.33                        | 700.000                  | EUR     | 768.219          | 0,43                         |
| RICHEMONT INTERNATIONAL           |                          |         |                   |                              | STATOIL ASA 1,25 %              |                          |         |                  |                              |
| HOLDING 1,125 % 26.05.32          | 100.000                  | EUR     | 93.254            | 0,05                         | 17.02.27                        | 500.000                  | EUR     | 511.187          | 0,28                         |
|                                   |                          |         | <b>495.185</b>    | <b>0,27</b>                  |                                 |                          |         | <b>1.279.406</b> | <b>0,71</b>                  |
| <b>NIEDERLANDE</b>                |                          |         |                   |                              | <b>SINGAPUR</b>                 |                          |         |                  |                              |
| ACHMEA 1,5 % 26.05.27             | 156.000                  | EUR     | 158.543           | 0,09                         | PFIZER INVESTMENT ENTERPRISES   |                          |         |                  |                              |
| ARGENTUM NETHERLANDS              |                          |         |                   |                              | 5,3 % 19.05.53                  | 1.000.000                | USD     | 997.882          | 0,55                         |
| 2,75 % VRN 19.02.49               | 600.000                  | EUR     | 614.574           | 0,34                         |                                 |                          |         | <b>997.882</b>   | <b>0,55</b>                  |
| ASR NEDERLAND 3,625 %             |                          |         |                   |                              | <b>SPANIEN</b>                  |                          |         |                  |                              |
| 12/12/2028                        | 110.000                  | EUR     | 119.145           | 0,07                         | AENA SME 4,25 % 13.10.2030      | 400.000                  | EUR     | 453.703          | 0,25                         |
| COOPERATIEVE RABOBANK             |                          |         |                   |                              | BANCO BILBAO VIZCAYA            |                          |         |                  |                              |
| 1,25 % 23.03.26                   | 600.000                  | EUR     | 624.906           | 0,35                         | 4,875 % VRN 08.02.36            | 200.000                  | EUR     | 218.015          | 0,12                         |
| GIVAUDAN FINANCE EUROPE           |                          |         |                   |                              | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENT     |                          |         |                  |                              |
| 1,625 % 22.04.32                  | 600.000                  | EUR     | 574.087           | 0,32                         | 0,875 % VRN 14.01.29            | 500.000                  | EUR     | 489.464          | 0,27                         |
| HM FINANCE 4,875 %                |                          |         |                   |                              | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA |                          |         |                  |                              |
| 25.10.31                          | 241.000                  | EUR     | 276.581           | 0,15                         | 1 % VRN 16.01.30                | 700.000                  | EUR     | 735.036          | 0,41                         |
| ING GROEP FRN 1 %                 |                          |         |                   |                              | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA |                          |         |                  |                              |
| 13.11.30                          | 500.000                  | EUR     | 512.828           | 0,28                         | 3,375 % 20.09.27                | 400.000                  | EUR     | 432.333          | 0,24                         |
| JDE PEETS 4,5 % 23.01.2034        | 301.000                  | EUR     | 338.605           | 0,19                         | BANCO SANTANDER 1,625 %         |                          |         |                  |                              |
| KONINKLIJKE 0,625 %               |                          |         |                   |                              | 22.10.30                        | 800.000                  | EUR     | 747.036          | 0,41                         |
| 09/04/2025                        | 800.000                  | EUR     | 838.113           | 0,45                         | BANCO SANTANDER 1,849 %         |                          |         |                  |                              |
| KONINKLIJKE 1,125 %               |                          |         |                   |                              | 25.03.26                        | 400.000                  | USD     | 373.858          | 0,21                         |
| 11/09/2028                        | 100.000                  | EUR     | 98.687            | 0,05                         | BANCO SANTANDER 3,496 %         |                          |         |                  |                              |
| KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE        |                          |         |                   |                              | 24.03.25                        | 1.000.000                | USD     | 981.957          | 0,55                         |
| 0,375 % 18.03.30                  | 700.000                  | EUR     | 643.422           | 0,36                         | BANCO SANTANDER 5,75 %          |                          |         |                  |                              |
| MERCEDESSENZ INTERNATIONAL        |                          |         |                   |                              | VRN 23.08.33                    | 500.000                  | EUR     | 568.048          | 0,31                         |
| FINANCE 3,25 % 10.01.32           | 301.000                  | EUR     | 324.573           | 0,18                         | BANCO SANTANDER 6,921 %         |                          |         |                  |                              |
| NN GROUP 6 % VRN                  |                          |         |                   |                              | 08/08/2033                      | 200.000                  | USD     | 209.550          | 0,12                         |
| 03/11/2043                        | 531.000                  | EUR     | 627.048           | 0,35                         | CAIXABANK 5 % VRN               |                          |         |                  |                              |
| NN GROUP 6,375 % VRN PERP         | 326.000                  | EUR     | 354.262           | 0,20                         | 19.07.29                        | 700.000                  | EUR     | 792.151          | 0,44                         |
| PLUXEE 3,5 % 04.09.28             | 300.000                  | EUR     | 324.438           | 0,18                         | CELLNEX FINANCE 1,5 %           |                          |         |                  |                              |
| RELX FINANCE 3,375 %              |                          |         |                   |                              | 08/06/2028                      | 600.000                  | EUR     | 596.215          | 0,33                         |
| 20.03.33                          | 566.000                  | EUR     | 613.397           | 0,34                         | IBERDROLA FINANZAS              |                          |         |                  |                              |
| SHELL INTERNATIONAL               |                          |         |                   |                              | 3,625 % 13.07.33                | 600.000                  | EUR     | 659.003          | 0,36                         |
| FINANCE 1,5 % 07.04.28            | 370.000                  | EUR     | 374.548           | 0,21                         | IBERDROLA FINANZAS              |                          |         |                  |                              |
| SIEMENS FINANCIERINGSMAATSCHAPP   |                          |         |                   |                              | 4,871 % VRN PERP                | 300.000                  | EUR     | 327.525          | 0,18                         |
| 0,375 % 05.06.26                  | 400.000                  | EUR     | 406.543           | 0,23                         | IBERDROLA FINANZAS              |                          |         |                  |                              |
| SIEMENS FINANCIERINGSMAATSCHAPPI  |                          |         |                   |                              | 4,875 % VRN PERP                | 600.000                  | EUR     | 658.644          | 0,36                         |
| 1,75 % 28.02.39                   | 400.000                  | EUR     | 352.410           | 0,20                         | MAPFRE 2,875 % 13.04.30         | 500.000                  | EUR     | 504.619          | 0,28                         |
| SIEMENS FINANCIERINGSMAATSCHAPPIJ |                          |         |                   |                              | SANTANDER CONSUMER              |                          |         |                  |                              |
| N 1 % 25.02.2030                  | 700.000                  | EUR     | 674.533           | 0,36                         | FINANCE 3,75 % 17.01.29         | 700.000                  | EUR     | 763.152          | 0,42                         |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC          |                          |         |                   |                              |                                 |                          |         | <b>9.510.309</b> | <b>5,26</b>                  |
| FINANCE 1,625 % 18.10.41          | 400.000                  | EUR     | 326.056           | 0,18                         | <b>SCHWEDEN</b>                 |                          |         |                  |                              |
| UNILEVER 1,75 % 25.03.2030        | 500.000                  | EUR     | 503.852           | 0,28                         | ASSA ABLOY 4,125 %              |                          |         |                  |                              |
| UNIVERSAL MUSIC GROUP             |                          |         |                   |                              | 13.09.35                        | 319.000                  | EUR     | 367.582          | 0,20                         |
| 4 % 13.06.31                      | 433.000                  | EUR     | 484.233           | 0,27                         | SKANDINAVISKA ENSKILDA          |                          |         |                  |                              |
| WOLTERS KLUWER 0,25 %             |                          |         |                   |                              | BANKEN 0,75 % 09.08.27          | 800.000                  | EUR     | 789.887          | 0,44                         |
| 30.03.28                          | 600.000                  | EUR     | 578.401           | 0,32                         | SVENSKA CELLULOSA               |                          |         |                  |                              |
|                                   |                          |         | <b>10.743.785</b> | <b>5,95</b>                  | 1,125 % 05.03.25                | 600.000                  | EUR     | 631.858          | 0,35                         |
|                                   |                          |         |                   |                              | TELE 3,75 % 22.11.29            | 276.000                  | EUR     | 301.198          | 0,17                         |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global ESG Corporate Bond (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--------------------------|---------|------------------|------------------------------|---|--------------------------|---------|-----------|------------------------------|
| VOLVO TREASURY 2,625 %<br>20.02.26                   | 353.000                  | EUR     | 374.856          | 0,21                         | ELI LILLY 0,625 %<br>01/11/2031                     | 100.000                  | EUR     | 91.257    | 0,05                         |
| VOLVO TREASURY 3,75 %<br>25.11.24                    | 572.000                  | EUR     | 617.292          | 0,34                         | ELI LILLY 5 % 09.02.2054                            | 345.000                  | USD     | 344.224   | 0,19                         |
|  |                          |         | <b>3.082.673</b> | <b>1,71</b>                  | EXELON 5,15 % 15.03.29                              | 185.000                  | USD     | 185.532   | 0,10                         |
| <b>SCHWEIZ</b>                                       |                          |         |                  |                              | GENERAL MOTORS<br>FINANCIAL 5,75 % 08.02.31         | 110.000                  | USD     | 111.289   | 0,06                         |
| UBS GROUP 2,746 %<br>11/02/2033                      | 440.000                  | USD     | 360.594          | 0,20                         | GENERAL MOTORS<br>FINANCIAL 5,8 % 07.01.29          | 595.000                  | USD     | 606.278   | 0,34                         |
| UBS GROUP 4,625 % VRN<br>17.03.28                    | 700.000                  | EUR     | 775.600          | 0,43                         | GILEAD SCIENCES 5,25 %<br>15.10.33                  | 720.000                  | USD     | 736.229   | 0,41                         |
| UBS GROUP FUNDING SWITZERLAND<br>1,25 % VRN 17.04.25 | 650.000                  | EUR     | 701.444          | 0,39                         | HCA 5,9 % 01.06.53                                  | 210.000                  | USD     | 211.871   | 0,12                         |
|  |                          |         | <b>1.837.638</b> | <b>1,02</b>                  | HCA 6 % 01.04.54                                    | 440.000                  | USD     | 448.067   | 0,25                         |
| <b>USA</b>   |                          |         |                  |                              | HCA 6,1 % 01.04.64                                  | 595.000                  | USD     | 603.875   | 0,33                         |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE<br>EQUITIES 5,15 % 15.04.2053 | 140.000                  | USD     | 129.071          | 0,07                         | INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES<br>3,625 % 06.02.31 | 600.000                  | EUR     | 661.960   | 0,37                         |
| AMERICAN HONDA FINANCE<br>2,3 % 09.09.26             | 350.000                  | USD     | 328.997          | 0,18                         | JPMORGAN CHASE 1,001 %<br>VRN 25.07.31              | 500.000                  | EUR     | 466.799   | 0,26                         |
| AMERICAN TOWER 5,25 %<br>15.07.28                    | 215.000                  | USD     | 215.335          | 0,12                         | JPMORGAN CHASE 5,299 %<br>VRN 24.07.29              | 400.000                  | USD     | 403.443   | 0,22                         |
| ASHTREAD CAPITAL 5,95 %<br>15.10.33                  | 245.000                  | USD     | 248.032          | 0,14                         | JPMORGAN CHASE 5,336 %<br>VRN 23.01.35              | 340.000                  | USD     | 341.772   | 0,19                         |
| ASTRAZENECA FINANCE<br>4,9 % 03.03.30                | 1.000.000                | USD     | 1.008.968        | 0,56                         | MASTERCARD 4,85 %<br>09/03/2033                     | 335.000                  | USD     | 337.938   | 0,19                         |
| ATT 5,4 % 15.02.34                                   | 460.000                  | USD     | 466.770          | 0,26                         | MERCK 4,5 % 17.05.33                                | 1.000.000                | USD     | 979.936   | 0,54                         |
| BANK OF AMERICA 0,694 %<br>VRN 22.03.31              | 400.000                  | EUR     | 366.054          | 0,20                         | MICROSOFT 2,921 %<br>17.03.52                       | 500.000                  | USD     | 355.013   | 0,20                         |
| BANK OF AMERICA 2,299 %<br>VRN 21.07.32              | 325.000                  | USD     | 266.684          | 0,15                         | MORGAN STANLEY 5,424 %<br>VRN 21.07.34              | 750.000                  | USD     | 754.021   | 0,42                         |
| BANK OF AMERICA 5,872 %<br>VRN 15.09.34              | 900.000                  | USD     | 934.608          | 0,52                         | MOTOROLA SOLUTIONS 5 %<br>15.04.29                  | 185.000                  | USD     | 184.263   | 0,10                         |
| BOOKING HOLDINGS 4,75 %<br>15.11.34                  | 500.000                  | EUR     | 595.735          | 0,33                         | MOTOROLA SOLUTIONS 5,4 %<br>15.04.34                | 165.000                  | USD     | 164.870   | 0,09                         |
| BP CAPITAL MARKETS<br>AMERICA 3,017 % 16.01.27       | 525.000                  | USD     | 501.932          | 0,28                         | NASDAQ 1,75 % 28.03.29                              | 700.000                  | EUR     | 699.565   | 0,39                         |
| BRISTOLMYERS SQUIBB<br>5,9 % 15.11.33                | 650.000                  | USD     | 695.068          | 0,38                         | NORTHERN TRUST 6,125 %<br>02/11/2032                | 500.000                  | USD     | 529.063   | 0,29                         |
| CISCO SYSTEMS 5,05 %<br>26.02.34                     | 665.000                  | USD     | 674.911          | 0,37                         | PEPSICO 4,2 % 18.07.52                              | 500.000                  | USD     | 439.321   | 0,24                         |
| COCACOLA 0,125 %<br>09/03/2029                       | 200.000                  | EUR     | 188.150          | 0,10                         | PNC FINANCIAL SERVICES<br>5,3 % VRN 21.01.28        | 450.000                  | USD     | 450.758   | 0,25                         |
| COCACOLA 0,8 % 15.03.40                              | 200.000                  | EUR     | 150.529          | 0,08                         | PNC FINANCIAL SERVICES<br>5,354 % VRN 02.12.28      | 1.000.000                | USD     | 1.005.756 | 0,56                         |
| COLGATEPALMOLIVE 0,875 %<br>12/11/2039               | 100.000                  | EUR     | 76.758           | 0,04                         | PROLOGIS EURO FINANCE<br>1 % 08.02.29               | 300.000                  | EUR     | 289.324   | 0,16                         |
| CONOCOPHILLIPS 5,55 %<br>15.03.54                    | 500.000                  | USD     | 516.589          | 0,29                         | SEMPRA ENERGY 5,5 %<br>01/08/2033                   | 400.000                  | USD     | 401.789   | 0,22                         |
| CVS HEALTH 5,875 %<br>01/06/2053                     | 180.000                  | USD     | 183.727          | 0,10                         | SYNCHRONY BANK 5,4 %<br>22.08.25                    | 355.000                  | USD     | 352.059   | 0,19                         |
| DISCOVER FINANCIAL<br>SERVICES 6,7 % 29.11.32        | 1.000.000                | USD     | 1.060.370        | 0,59                         | TARGA RESOURCES PARTNERS<br>6,15 % 01.03.29         | 385.000                  | USD     | 401.518   | 0,22                         |
| DOMINION ENERGY 5,375 %<br>15.11.32                  | 1.000.000                | USD     | 1.009.074        | 0,56                         | UNITED STATES TREASURY NOTE<br>4,25 % 15.03.27      | 500.000                  | USD     | 498.066   | 0,28                         |
|  |                          |         |                  |                              | UNITEDHEALTH GROUP<br>5,375 % 15.04.54              | 550.000                  | USD     | 560.697   | 0,31                         |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global ESG Corporate Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung                                   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|--------------------|------------------------------|--|--------------------------|---------|------------------|------------------------------|
| US (GOVT) 3,625 % 15.02.53  | 1.088.000                | USD     | 958.630            | 0,53                         | <b>DEUTSCHLAND</b>                             |                          |         |                  |                              |
| US (GOVT) 3,875 % 15.02.43  | 100.000                  | USD     | 92.742             | 0,05                         | DEUTSCHE BANK 2,311 %<br>VRN 16.11.27          | 315.000                  | USD     | 288.100          | 0,16                         |
| US (GOVT) 4 % 31.01.29  | 1.099.000                | USD     | 1.088.827          | 0,60                         | DEUTSCHE BANK 3,742 %<br>VRN 07.01.33          | 765.000                  | USD     | 633.157          | 0,35                         |
| US (GOVT) 4 % 15.11.42  | 500.000                  | USD     | 472.422            | 0,26                         | DEUTSCHE BANK 6,119 %<br>VRN 14.07.26          | 500.000                  | USD     | 502.006          | 0,28                         |
| US (GOVT) 4,125 %<br>15.02.27   | 600.000                  | USD     | 595.406            | 0,33                         |  |                          |         | <b>1.423.263</b> | <b>0,79</b>                  |
| US BANCORP 5,678 % VRN<br>23.01.35  | 245.000                  | USD     | 247.920            | 0,14                         | <b>GROSSBRITANNIEN</b>                         |                          |         |                  |                              |
| VENTAS REALTY 2,65 %<br>15.01.25  | 200.000                  | USD     | 195.124            | 0,11                         | COCACOLA EUROPEAN<br>PARTNERS 0,8 % 03.05.24   | 375.000                  | USD     | 373.509          | 0,21                         |
| VERIZON COMMUNICATIONS<br>4,75 % 31.10.34   | 800.000                  | EUR     | 950.212            | 0,53                         | LLOYDS BANKING GROUP<br>4,75 % VRN 21.09.31    | 367.000                  | EUR     | 417.441          | 0,23                         |
|   |                          |         | <b>27.835.198</b>  | <b>15,41</b>                 | NATIONWIDE BUILDING<br>SOCIETY 4,85 % 27.07.27 | 1.000.000                | USD     | 991.474          | 0,55                         |
| <b>SUMME ANLEIHEN</b>   |                          |         | <b>107.821.079</b> | <b>59,69</b>                 |  |                          |         | <b>1.782.424</b> | <b>0,99</b>                  |
| <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN<br/>BÖRSE NOTIERTEN WERTPAPIERE<br/>WERTPAPIERE</b> |                          |         | <b>107.821.079</b> | <b>59,69</b>                 | <b>IRLAND</b>                                  |                          |         |                  |                              |
| <b>AN EINEM ANDEREM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE, ÜBERTRAGBARE<br/>WERTPAPIERE</b>    |                          |         |                    |                              | AIB GROUP 6,608 % VRN<br>13.09.29              | 210.000                  | USD     | 219.081          | 0,12                         |
| <b>ANLEIHEN</b>   |                          |         |                    |                              | DELL BANK INTERNATIONAL<br>0,5 % 27.10.26      | 700.000                  | EUR     | 701.838          | 0,39                         |
| <b>BELGIEN</b>  |                          |         |                    |                              | SMURFIT KAPPA TREASURY<br>5,2 % 15.01.30       | 200.000                  | USD     | 199.857          | 0,11                         |
| KBC GROUP 6,324 % VRN<br>21.09.34   | 335.000                  | USD     | 352.216            | 0,20                         | SMURFIT KAPPA TREASURY<br>5,777 % 03.04.54     | 200.000                  | USD     | 200.000          | 0,11                         |
|   |                          |         | <b>352.216</b>     | <b>0,20</b>                  |  |                          |         | <b>1.320.776</b> | <b>0,73</b>                  |
| <b>KANADA</b>   |                          |         |                    |                              | <b>ITALIEN</b>                                 |                          |         |                  |                              |
| BANK OF NOVA SCOTIA<br>1,35 % 24.06.26  | 750.000                  | USD     | 691.836            | 0,38                         | INTESA SANPAOLO 3,25 %<br>23.09.24             | 200.000                  | USD     | 197.664          | 0,11                         |
| NATIONAL BANK OF CANADA<br>5,6 % 18.12.28   | 250.000                  | USD     | 254.496            | 0,14                         | INTESA SANPAOLO 3,875 %<br>14.07.27            | 425.000                  | USD     | 399.862          | 0,22                         |
|   |                          |         | <b>946.332</b>     | <b>0,52</b>                  | INTESA SANPAOLO 6,625 %<br>20.06.33            | 290.000                  | USD     | 301.803          | 0,17                         |
| <b>FRANKREICH</b>   |                          |         |                    |                              | INTESA SANPAOLO 7,2 %<br>28.11.33              | 250.000                  | USD     | 270.348          | 0,15                         |
| BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT<br>MUTUEL 5,088 % 23.01.27                              | 370.000                  | USD     | 370.056            | 0,20                         | INTESA SANPAOLO 7,8 %<br>28.11.53              | 295.000                  | USD     | 335.124          | 0,19                         |
| BNP PARIBAS 5,125 % VRN<br>13.01.29   | 2.000.000                | USD     | 1.999.503          | 1,11                         |  |                          |         | <b>1.504.801</b> | <b>0,84</b>                  |
| BPCE 1,652 % VRN<br>06/10/2026  | 650.000                  | USD     | 610.682            | 0,34                         | <b>JAPAN</b>                                   |                          |         |                  |                              |
| CREDIT AGRICOLE 1,907 %<br>VRN 16.06.26   | 750.000                  | USD     | 717.402            | 0,40                         | MIZUHO FINANCIAL GROUP<br>0,214 % 07.10.25     | 340.000                  | EUR     | 349.777          | 0,19                         |
| CREDIT AGRICOLE 5,301 %<br>12/07/2028   | 1.000.000                | USD     | 1.011.105          | 0,56                         |  |                          |         | <b>349.777</b>   | <b>0,19</b>                  |
| CREDIT AGRICOLE 5,514 %<br>05/07/2033   | 420.000                  | USD     | 430.401            | 0,24                         | <b>NIEDERLANDE</b>                             |                          |         |                  |                              |
| SOCIETE GENERALE 3,337 %<br>VRN 21.01.33  | 1.000.000                | USD     | 839.342            | 0,46                         | AKZO NOBEL 1,625 %<br>14.04.30                 | 600.000                  | EUR     | 585.607          | 0,33                         |
|   |                          |         | <b>5.978.491</b>   | <b>3,31</b>                  | COOPERATIEVE RABOBANK<br>3,758 % VRN 06.04.33  | 635.000                  | USD     | 568.201          | 0,31                         |
|   |                          |         |                    |                              | ENEL FINANCE INTERNATIONAL<br>5,5 % 15.06.52   | 380.000                  | USD     | 357.584          | 0,20                         |
|   |                          |         |                    |                              | ING GROEP 0,25 % VRN<br>18.02.29               | 400.000                  | EUR     | 379.166          | 0,21                         |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global ESG Corporate Bond (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung                                     | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|------------------|------------------------------|--|--------------------------|---------|----------|------------------------------|
| NXP FUNDING 3,125 %<br>15.02.42                       | 680.000                  | USD     | 491.025          | 0,27                         | BOSTON PROPERTIES 2,9 %<br>15.03.30              | 550.000                  | USD     | 471.903  | 0,26                         |
|   |                          |         | <b>2.381.583</b> | <b>1,32</b>                  | BRISTOLMYERS SQUIBB<br>5,2 % 22.02.34            | 200.000                  | USD     | 203.513  | 0,11                         |
| <b>SPANIEN</b>  |                          |         |                  |                              | CHARTER COMMS OPERATING<br>6,484 % 23.10.45      | 935.000                  | USD     | 869.692  | 0,48                         |
| CAIXABANK 5,673 % VRN<br>15.03.30                     | 290.000                  | USD     | 290.069          | 0,16                         | CITIGROUP 0,776 % VRN<br>30.10.24                | 200.000                  | USD     | 200.277  | 0,11                         |
| CAIXABANK 6,037 % VRN<br>15.06.35                     | 290.000                  | USD     | 293.009          | 0,16                         | CITIGROUP 2,572 % VRN<br>03/06/2031              | 550.000                  | USD     | 470.350  | 0,26                         |
|   |                          |         | <b>583.078</b>   | <b>0,32</b>                  | COCACOLA 1,45 % 01.06.27                         | 200.000                  | USD     | 182.256  | 0,10                         |
| <b>SCHWEDEN</b>                                       |                          |         |                  |                              | COLGATE PALMOLIVE 1,375 %<br>06/03/2034          | 300.000                  | EUR     | 278.846  | 0,15                         |
| SVENSKA HANDELSBANKEN<br>0,05 % 06.09.28              | 692.000                  | EUR     | 652.804          | 0,36                         | CONOCO PHILLIPS 3,758 %<br>15.03.42              | 150.000                  | USD     | 125.007  | 0,07                         |
|   |                          |         | <b>652.804</b>   | <b>0,36</b>                  | CROWN CASTLE INTERNATIONAL<br>2,25 % 15.01.31    | 200.000                  | USD     | 164.931  | 0,09                         |
| <b>SCHWEIZ</b>  |                          |         |                  |                              | CROWN CASTLE INTERNATIONAL<br>4 % 15.11.49       | 175.000                  | USD     | 136.356  | 0,08                         |
| UBS GROUP 1,364 % VRN<br>30.01.27                     | 375.000                  | USD     | 347.222          | 0,19                         | CVS HEALTH 2,7 %<br>21.08.40                     | 600.000                  | USD     | 418.540  | 0,23                         |
|   |                          |         | <b>347.222</b>   | <b>0,19</b>                  | ENEL FINANCE AMERICA<br>2,875 % 12.07.41         | 700.000                  | USD     | 477.784  | 0,26                         |
| <b>USA</b>  |                          |         |                  |                              | EQUIFAX 2,35 % 15.09.2031                        | 310.000                  | USD     | 256.418  | 0,14                         |
| ABBVIE 5,4 % 15.03.54                                 | 320.000                  | USD     | 330.101          | 0,18                         | EQUINIX 2,15 % 15.07.30                          | 375.000                  | USD     | 311.767  | 0,17                         |
| ADOBE 2,15 % 01.02.27                                 | 350.000                  | USD     | 327.185          | 0,18                         | FIVE CORNERS FUNDING<br>TRUST 5,791 % 15.02.33   | 730.000                  | USD     | 752.981  | 0,42                         |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE<br>EQUITIES 3,375 % 15.08.31   | 350.000                  | USD     | 312.778          | 0,17                         | FIVE CORNERS FUNDING<br>TRUST 5,997 % 15.02.53   | 750.000                  | USD     | 796.089  | 0,44                         |
| AMERICAN TOWER 0,5 %<br>15.01.28                      | 500.000                  | EUR     | 482.186          | 0,27                         | FORTUNE BRANDS HOME<br>SECURITY 4,5 % 25.03.2052 | 430.000                  | USD     | 354.947  | 0,20                         |
| AMGEN 2,3 % 25.02.31                                  | 200.000                  | USD     | 169.380          | 0,09                         | GOLDMAN SACHS GROUP<br>0,855 % VRN 12.02.26      | 200.000                  | USD     | 191.639  | 0,11                         |
| AMGEN 2,8 % 15.08.41                                  | 500.000                  | USD     | 363.635          | 0,20                         | HCA 3,5 % 15.07.51                               | 500.000                  | USD     | 346.187  | 0,19                         |
| AMGEN 4,563 % 15.06.48                                | 450.000                  | USD     | 397.219          | 0,22                         | HCA 4,625 % 15.03.52                             | 160.000                  | USD     | 134.302  | 0,07                         |
| AMGEN 4,875 % 01.03.53                                | 360.000                  | USD     | 328.803          | 0,18                         | HOME DEPOT 3,35 %<br>15.04.50                    | 350.000                  | USD     | 257.413  | 0,14                         |
| APPLE 3,95 % 08.08.52                                 | 500.000                  | USD     | 422.341          | 0,23                         | JACKSON FINANCIAL<br>3,125 % 23.11.31            | 125.000                  | USD     | 104.447  | 0,06                         |
| APPLIED MATERIALS 2,75 %<br>01/06/2050                | 375.000                  | USD     | 257.114          | 0,14                         | JOHN DEERE CAPITAL<br>2,25 % 14.09.26            | 275.000                  | USD     | 258.557  | 0,14                         |
| ASHTREAD CAPITAL 5,8 %<br>15.04.34                    | 2.180.000                | USD     | 2.186.526        | 1,22                         | JPMORGAN CHASE 0,969 %<br>VRN 23.06.25           | 500.000                  | USD     | 494.249  | 0,27                         |
| AT&T 2,6 % 17.12.29                                   | 700.000                  | EUR     | 726.806          | 0,40                         | JPMORGAN CHASE 2,522 %<br>VRN 22.04.31           | 195.000                  | USD     | 168.859  | 0,09                         |
| ATT 3,5 % 15.09.53                                    | 700.000                  | USD     | 495.297          | 0,27                         | LAM RESEARCH 2,875 %<br>15.06.50                 | 375.000                  | USD     | 257.146  | 0,14                         |
| AVIATION CAPITAL GROUP<br>1,95 % 20.09.26             | 395.000                  | USD     | 361.276          | 0,20                         | LOWES 4,25 % 01.04.52                            | 400.000                  | USD     | 328.826  | 0,18                         |
| AVIATION CAPITAL GROUP<br>6,375 % 15.07.30            | 370.000                  | USD     | 381.410          | 0,21                         | LOWES 5 % 15.04.40                               | 336.000                  | USD     | 323.113  | 0,18                         |
| BANK OF AMERICA 1,197 %<br>VRN 24.10.26               | 125.000                  | USD     | 117.027          | 0,06                         | LOWES COS 2,8 % 15.09.41                         | 250.000                  | USD     | 178.620  | 0,10                         |
| BANK OF AMERICA 2,482 %<br>VRN 21.09.36               | 555.000                  | USD     | 444.045          | 0,25                         | MASTERCARD 2,95 %<br>15.03.51                    | 375.000                  | USD     | 263.162  | 0,15                         |
| BANK OF AMERICA 3,846 %<br>VRN 08.03.37               | 930.000                  | USD     | 825.022          | 0,46                         |  |                          |         |          |                              |
| BANK OF AMERICA 4,571 %<br>VRN 27.04.33               | 460.000                  | USD     | 437.542          | 0,24                         |  |                          |         |          |                              |
| BANK OF NEW YORK MELLON<br>COR 4,596 % VRN 26.07.2030 | 1.000.000                | USD     | 983.711          | 0,55                         |  |                          |         |          |                              |
| BMW US CAPITAL 4,9 %<br>02/04/2029                    | 175.000                  | USD     | 175.016          | 0,10                         |  |                          |         |          |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global ESG Corporate Bond (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|---|--------------------------|---------|--------------------|------------------------------|
| MERCEDESSENZ FINANCE NORTH AMERICA<br>5 % 11.01.34                                  | 450.000                  | USD     | 446.595           | 0,25                         | <b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>                  |                          |         |                    |                              |
| MERCEDESSENZ FINANCE NORTH AMERICA<br>5,1 % 03.08.28                                | 345.000                  | USD     | 346.868           | 0,19                         | <b>GROSSBRITANNIEN</b>                                    |                          |         |                    |                              |
| METROPOLITAN LIFE GLOBAL<br>FUNDING 3,3 % 21.03.2029                                | 625.000                  | USD     | 580.057           | 0,32                         | HSBC CORPORATE BOND<br>FUND INSTITUTIONAL<br>ACCUMULATION | 3.955.000                | GBP     | 17.880.533         | 9,90                         |
| MICRON TECHNOLOGY<br>4,975 % 06.02.26   | 325.000                  | USD     | 323.513           | 0,18                         |   |                          |         | <b>17.880.533</b>  | <b>9,90</b>                  |
| MORGAN STANLEY 1,164 %<br>VRN 21.10.25  | 300.000                  | USD     | 292.188           | 0,16                         | <b>IRLAND</b>   |                          |         |                    |                              |
| MORGAN STANLEY 1,512 %<br>VRN 20.07.27  | 750.000                  | USD     | 688.955           | 0,38                         | HSBC GLOBAL LIQUIDITY<br>FUND                             | 14                       | USD     | 14                 | 0,00                         |
| MORGAN STANLEY 2,484 %<br>VRN 16.09.36  | 200.000                  | USD     | 158.290           | 0,09                         |   |                          |         | <b>14</b>          | <b>0,00</b>                  |
| MORGAN STANLEY 4,457 %<br>VRN 22.04.39  | 300.000                  | USD     | 272.976           | 0,15                         | <b>SUMME ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>            |                          |         | <b>17.880.547</b>  | <b>9,90</b>                  |
| NESTLE HOLDINGS 4,85 %<br>14.03.33  | 1.000.000                | USD     | 1.012.737         | 0,57                         | <b>GELDMARKTINSTRUMENTE</b>                               |                          |         |                    |                              |
| NEWMONT CORP NEWCREST<br>FINANCE 5,35 % 15.03.34                                    | 315.000                  | USD     | 317.194           | 0,18                         | <b>SCHATZWECHSEL</b>                                      |                          |         |                    |                              |
| NIKE 2,75 % 27.03.27  | 275.000                  | USD     | 260.662           | 0,14                         | <b>USA</b>  |                          |         |                    |                              |
| PEPSICO 0,5 % 06.05.28  | 150.000                  | EUR     | 146.465           | 0,08                         | US (GOVT) 0 % 19.09.24                                    | 2.000.000                | USD     | 1.951.429          | 1,08                         |
| PVH CORP 3,125 %<br>15.12.27  | 800.000                  | EUR     | 850.253           | 0,48                         |   |                          |         | <b>1.951.429</b>   | <b>1,08</b>                  |
| SYNCHRONY FINANCIAL<br>2,875 % 28.10.31   | 440.000                  | USD     | 352.411           | 0,20                         | <b>SUMME SCHATZWECHSEL</b>                                |                          |         | <b>1.951.429</b>   | <b>1,08</b>                  |
| SYNCHRONY FINANCIAL<br>4,875 % 13.06.25   | 615.000                  | USD     | 606.215           | 0,34                         | <b>GELDMARKTINSTRUMENTE GESAMT</b>                        |                          |         | <b>1.951.429</b>   | <b>1,08</b>                  |
| TEXAS INSTRUMENTS 2,7 %<br>15.09.51   | 400.000                  | USD     | 261.180           | 0,14                         | <b>SUMME WERTPAPIERANLAGEN</b>                            |                          |         | <b>177.063.349</b> | <b>98,03</b>                 |
| TEXAS INSTRUMENTS 4,1 %<br>16.08.52   | 900.000                  | USD     | 767.325           | 0,42                         | <b>SONSTIGES NETTOVERMÖGEN</b>                            |                          |         | <b>3.559.138</b>   | <b>1,97</b>                  |
| TEXAS INSTRUMENTS 4,6 %<br>15.02.28   | 1.000.000                | USD     | 1.001.803         | 0,56                         | <b>GESAMTNETTOVERMÖGEN</b>                                |                          |         | <b>180.622.487</b> | <b>100,00</b>                |
| TRUIST FINANCIAL 5,711 %<br>VRN 24.01.35  | 200.000                  | USD     | 201.317           | 0,11                         |   |                          |         |                    |                              |
| US (GOVT) 2,25 % 15.02.52   | 680.000                  | USD     | 448.906           | 0,25                         |   |                          |         |                    |                              |
| US (GOVT) 4 % 15.02.34  | 175.000                  | USD     | 172.389           | 0,10                         |   |                          |         |                    |                              |
| US BANCORP 4,967 % VRN<br>22.07.33  | 1.000.000                | USD     | 947.148           | 0,53                         |   |                          |         |                    |                              |
| VERIZON COMMUNICATIONS<br>2,85 % 03.09.41   | 500.000                  | USD     | 361.219           | 0,20                         |   |                          |         |                    |                              |
| VMWARE 4,65 % 15.05.27  | 325.000                  | USD     | 319.957           | 0,18                         |   |                          |         |                    |                              |
| WARNERMEDIA HOLDINGS<br>5,05 % 15.03.42   | 405.000                  | USD     | 348.307           | 0,19                         |   |                          |         |                    |                              |
|   |                          |         | <b>31.787.527</b> | <b>17,60</b>                 |   |                          |         |                    |                              |
| <b>SUMME ANLEIHEN</b>   |                          |         | <b>49.410.294</b> | <b>27,36</b>                 |   |                          |         |                    |                              |
| <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN<br/>MARKT GEHANDELTEN ÜBERTRAGBAREN WERTPAPIERE</b> |                          |         | <b>49.410.294</b> | <b>27,36</b>                 |   |                          |         |                    |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Government Bond

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung                 | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|----------|------------------------------|------------------------------|--------------------------|---------|----------|------------------------------|
| <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>  |                          |         |          |                              | <b>BELGIUM (GOVT) 3,45 %</b> |                          |         |          |                              |
| <b>AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |                          |         |          |                              | 22.06.43                     |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |          |                              | 5.000.000                    |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |          |                              | EUR                          |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |          |                              | 5.568.947                    |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |          |                              | 0,13                         |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |          |                              | <b>BELGIUM (GOVT) 3,75 %</b> |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |          |                              | 22.06.45                     |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |          |                              | 2.000.000                    |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |          |                              | EUR                          |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |          |                              | 2.326.129                    |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |          |                              | 0,05                         |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |          |                              | <b>49.618.072</b>            |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |          |                              | <b>1,16</b>                  |                          |         |          |                              |
| <b>ANLEIHEN</b>   |                          |         |          |                              | <b>KANADA</b>                |                          |         |          |                              |
| <b>AUSTRALIEN</b>   |                          |         |          |                              | CANADA (GOVT) 2,75 %         |                          |         |          |                              |
| AUSTRALIA (GOVT) 0,25 %   |                          |         |          |                              | 01/12/2055                   |                          |         |          |                              |
| 21.11.24  |                          |         |          |                              | 10.050.000                   |                          |         |          |                              |
| AUD   |                          |         |          |                              | CAD                          |                          |         |          |                              |
| 6.401.195   |                          |         |          |                              | 4.921.282                    |                          |         |          |                              |
| 0,15  |                          |         |          |                              | 0,12                         |                          |         |          |                              |
| AUSTRALIA (GOVT) 0,25 %   |                          |         |          |                              | CANADA (GOVT) 3,5 %          |                          |         |          |                              |
| 21.11.25  |                          |         |          |                              | 01/08/2025                   |                          |         |          |                              |
| 30.000.000  |                          |         |          |                              | 40.000.000                   |                          |         |          |                              |
| AUD   |                          |         |          |                              | CAD                          |                          |         |          |                              |
| 18.489.923  |                          |         |          |                              | 29.208.688                   |                          |         |          |                              |
| 0,43  |                          |         |          |                              | 0,69                         |                          |         |          |                              |
| AUSTRALIA (GOVT) 1,75 %   |                          |         |          |                              | CANADA (GOVT) 3,5 %          |                          |         |          |                              |
| 21.06.51  |                          |         |          |                              | 01/12/2045                   |                          |         |          |                              |
| 2.000.000   |                          |         |          |                              | 5.000.000                    |                          |         |          |                              |
| AUD   |                          |         |          |                              | CAD                          |                          |         |          |                              |
| 763.506   |                          |         |          |                              | 3.755.175                    |                          |         |          |                              |
| 0,02  |                          |         |          |                              | 0,09                         |                          |         |          |                              |
| AUSTRALIA (GOVT) 2,25 %   |                          |         |          |                              | CANADA (GOVT) 3,75 %         |                          |         |          |                              |
| 21.05.28  |                          |         |          |                              | 01/02/2025                   |                          |         |          |                              |
| 22.190.000  |                          |         |          |                              | 43.000.000                   |                          |         |          |                              |
| AUD   |                          |         |          |                              | CAD                          |                          |         |          |                              |
| 13.723.807  |                          |         |          |                              | 31.526.096                   |                          |         |          |                              |
| 0,32  |                          |         |          |                              | 0,73                         |                          |         |          |                              |
| AUSTRALIA (GOVT) 3 %  |                          |         |          |                              | CANADA (GOVT) 3,75 %         |                          |         |          |                              |
| 21.11.33  |                          |         |          |                              | 01/05/2025                   |                          |         |          |                              |
| 75.000.000  |                          |         |          |                              | 65.000.000                   |                          |         |          |                              |
| AUD   |                          |         |          |                              | CAD                          |                          |         |          |                              |
| 45.120.666  |                          |         |          |                              | 47.634.537                   |                          |         |          |                              |
| 1,06  |                          |         |          |                              | 1,11                         |                          |         |          |                              |
| AUSTRALIA (GOVT) 3 %  |                          |         |          |                              | CANADA (GOVT) 4 %            |                          |         |          |                              |
| 21.03.47  |                          |         |          |                              | 01/05/2026                   |                          |         |          |                              |
| 890.000   |                          |         |          |                              | 20.000.000                   |                          |         |          |                              |
| AUD   |                          |         |          |                              | CAD                          |                          |         |          |                              |
| 466.244   |                          |         |          |                              | 14.762.097                   |                          |         |          |                              |
| 0,01  |                          |         |          |                              | 0,35                         |                          |         |          |                              |
| AUSTRALIA (GOVT) 3,5 %  |                          |         |          |                              | CANADA (GOVT) 4,5 %          |                          |         |          |                              |
| 21.12.34  |                          |         |          |                              | 01/11/2025                   |                          |         |          |                              |
| 35.000.000  |                          |         |          |                              | 10.000.000                   |                          |         |          |                              |
| AUD   |                          |         |          |                              | CAD                          |                          |         |          |                              |
| 21.821.839  |                          |         |          |                              | 7.411.752                    |                          |         |          |                              |
| 0,51  |                          |         |          |                              | 0,17                         |                          |         |          |                              |
| AUSTRALIA (GOVT) 4,5 %  |                          |         |          |                              | CANADA (GOVT) 4,5 %          |                          |         |          |                              |
| 21.04.33  |                          |         |          |                              | 01/02/2026                   |                          |         |          |                              |
| 5.000.000   |                          |         |          |                              | 20.000.000                   |                          |         |          |                              |
| AUD   |                          |         |          |                              | CAD                          |                          |         |          |                              |
| 3.396.229   |                          |         |          |                              | 14.863.651                   |                          |         |          |                              |
| 0,08  |                          |         |          |                              | <b>154.083.278</b>           |                          |         |          |                              |
| AUSTRALIA (GOVT) 4,75 %   |                          |         |          |                              | <b>3,61</b>                  |                          |         |          |                              |
| 21.04.27  |                          |         |          |                              | <b>DÄNEMARK</b>              |                          |         |          |                              |
| 6.610.000   |                          |         |          |                              | DENMARK (GOVT) 0 %           |                          |         |          |                              |
| AUD   |                          |         |          |                              | 15.11.31                     |                          |         |          |                              |
| 4.452.843   |                          |         |          |                              | 40.000.000                   |                          |         |          |                              |
| 0,10  |                          |         |          |                              | DKK                          |                          |         |          |                              |
| AUSTRALIA (GOVT) 4,75 %   |                          |         |          |                              | 4.896.930                    |                          |         |          |                              |
| 21.06.54  |                          |         |          |                              | 0,12                         |                          |         |          |                              |
| 5.000.000   |                          |         |          |                              | DENMARK (GOVT) 0,5 %         |                          |         |          |                              |
| AUD   |                          |         |          |                              | 15.11.27                     |                          |         |          |                              |
| 3.479.549   |                          |         |          |                              | 19.500.000                   |                          |         |          |                              |
| 0,08  |                          |         |          |                              | DKK                          |                          |         |          |                              |
| NEW SOUTH WALES   |                          |         |          |                              | 2.643.882                    |                          |         |          |                              |
| TREASURY 4,75 % 20.02.2035  |                          |         |          |                              | 0,06                         |                          |         |          |                              |
| 18.000.000  |                          |         |          |                              | DENMARK (GOVT) 4,5 %         |                          |         |          |                              |
| AUD   |                          |         |          |                              | 15.11.39                     |                          |         |          |                              |
| 11.777.176  |                          |         |          |                              | 7.000.000                    |                          |         |          |                              |
| 0,28  |                          |         |          |                              | DKK                          |                          |         |          |                              |
| QUEENSLAND TREASURY   |                          |         |          |                              | 1.276.630                    |                          |         |          |                              |
| 4,5 % 09.03.33  |                          |         |          |                              | <b>8.817.442</b>             |                          |         |          |                              |
| 19.812.000  |                          |         |          |                              | <b>0,21</b>                  |                          |         |          |                              |
| AUD   |                          |         |          |                              | <b>FRANKREICH</b>            |                          |         |          |                              |
| 13.006.359  |                          |         |          |                              | FRANCE (GOVT) 0 %            |                          |         |          |                              |
| 0,31  |                          |         |          |                              | 25.11.30                     |                          |         |          |                              |
| SOUTH AUSTRALIAN GOVERNMENT                                       |                          |         |          |                              | 20.000.000                   |                          |         |          |                              |
| FINANCE 4,75 % 24.05.38   |                          |         |          |                              | EUR                          |                          |         |          |                              |
| 17.853.000  |                          |         |          |                              | 18.172.898                   |                          |         |          |                              |
| AUD   |                          |         |          |                              | 0,43                         |                          |         |          |                              |
| <b>154.258.659</b>  |                          |         |          |                              | FRANCE (GOVT) 0 %            |                          |         |          |                              |
| <b>3,62</b>   |                          |         |          |                              | 25.05.32                     |                          |         |          |                              |
| <b>BELGIEN</b>  |                          |         |          |                              | 2.400.000                    |                          |         |          |                              |
| BELGIUM (GOVT) 0,1 %  |                          |         |          |                              | EUR                          |                          |         |          |                              |
| 22.06.30  |                          |         |          |                              | 2.087.642                    |                          |         |          |                              |
| 4.000.000   |                          |         |          |                              | 0,05                         |                          |         |          |                              |
| EUR   |                          |         |          |                              | FRANCE (GOVT) 0,5 %          |                          |         |          |                              |
| 3.698.283   |                          |         |          |                              | 25.05.29                     |                          |         |          |                              |
| 0,09  |                          |         |          |                              | 15.000.000                   |                          |         |          |                              |
| BELGIUM (GOVT) 0,65 %   |                          |         |          |                              | EUR                          |                          |         |          |                              |
| 22.06.71  |                          |         |          |                              | 14.563.343                   |                          |         |          |                              |
| 2.500.000   |                          |         |          |                              | 0,34                         |                          |         |          |                              |
| EUR   |                          |         |          |                              | FRANCE (GOVT) 0,5 %          |                          |         |          |                              |
| 1.167.613   |                          |         |          |                              | 25.05.72                     |                          |         |          |                              |
| 0,03  |                          |         |          |                              | 12.500.000                   |                          |         |          |                              |
| BELGIUM (GOVT) 0,9 %  |                          |         |          |                              | EUR                          |                          |         |          |                              |
| 22.06.29  |                          |         |          |                              | 5.367.310                    |                          |         |          |                              |
| 930.000   |                          |         |          |                              | 0,13                         |                          |         |          |                              |
| EUR   |                          |         |          |                              | FRANCE (GOVT) 0,75 %         |                          |         |          |                              |
| 921.835   |                          |         |          |                              | 25.02.28                     |                          |         |          |                              |
| 0,02  |                          |         |          |                              | 20.000.000                   |                          |         |          |                              |
| BELGIUM (GOVT) 1 %  |                          |         |          |                              | EUR                          |                          |         |          |                              |
| 22.06.26  |                          |         |          |                              | 20.086.495                   |                          |         |          |                              |
| 2.100.000   |                          |         |          |                              | 0,47                         |                          |         |          |                              |
| EUR   |                          |         |          |                              | FRANCE (GOVT) 0,75 %         |                          |         |          |                              |
| 2.179.646   |                          |         |          |                              | 25.05.52                     |                          |         |          |                              |
| 0,05  |                          |         |          |                              | 4.500.000                    |                          |         |          |                              |
| BELGIUM (GOVT) 1,4 %  |                          |         |          |                              | EUR                          |                          |         |          |                              |
| 22.06.53  |                          |         |          |                              | 2.674.611                    |                          |         |          |                              |
| 10.000.000  |                          |         |          |                              | 0,06                         |                          |         |          |                              |
| EUR   |                          |         |          |                              | FRANCE (GOVT) 0,75 %         |                          |         |          |                              |
| 7.003.786   |                          |         |          |                              | 25.05.53                     |                          |         |          |                              |
| 0,16  |                          |         |          |                              | 20.000.000                   |                          |         |          |                              |
| BELGIUM (GOVT) 1,45 %   |                          |         |          |                              | EUR                          |                          |         |          |                              |
| 22.06.37  |                          |         |          |                              | 11.618.943                   |                          |         |          |                              |
| 9.500.000   |                          |         |          |                              | 0,27                         |                          |         |          |                              |
| EUR   |                          |         |          |                              | FRANCE (GOVT) 1,25 %         |                          |         |          |                              |
| 8.526.399   |                          |         |          |                              | 25.05.34                     |                          |         |          |                              |
| 0,20  |                          |         |          |                              | 3.000.000                    |                          |         |          |                              |
| BELGIUM (GOVT) 2,6 %  |                          |         |          |                              | EUR                          |                          |         |          |                              |
| 22.06.24  |                          |         |          |                              | 2.796.048                    |                          |         |          |                              |
| 6.730.000   |                          |         |          |                              | 0,07                         |                          |         |          |                              |
| EUR   |                          |         |          |                              | FRANCE (GOVT) 1,25 %         |                          |         |          |                              |
| 7.248.019   |                          |         |          |                              | 25.05.38                     |                          |         |          |                              |
| 0,17  |                          |         |          |                              | 5.000.000                    |                          |         |          |                              |
| BELGIUM (GOVT) 3 %  |                          |         |          |                              | EUR                          |                          |         |          |                              |
| 22.06.33  |                          |         |          |                              | 4.299.361                    |                          |         |          |                              |
| 10.000.000  |                          |         |          |                              | 0,10                         |                          |         |          |                              |
| EUR   |                          |         |          |                              | FRANCE (GOVT) 2,5 %          |                          |         |          |                              |
| 10.977.415  |                          |         |          |                              | 24.09.26                     |                          |         |          |                              |
| 0,26  |                          |         |          |                              | 20.000.000                   |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |          |                              | EUR                          |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |          |                              | 21.431.707                   |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |          |                              | 0,50                         |                          |         |          |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Government Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapiieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung                      | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|--------------------|------------------------------|-----------------------------------|--------------------------|---------|--------------------|------------------------------|
| FRANCE (GOVT) 2,5 %<br>25.05.43                     | 20.000.000               | EUR     | 19.504.605         | 0,46                         | UK (GOVT) 0,875 %<br>31.01.46     | 25.300.000               | GBP     | 16.360.676         | 0,38                         |
| FRANCE (GOVT) 2,75 %<br>25.02.29                    | 42.500.000               | EUR     | 46.115.421         | 1,08                         | UK (GOVT) 1,125 %<br>22.10.73     | 3.500.000                | GBP     | 1.685.094          | 0,04                         |
| FRANCE (GOVT) 3 %<br>25.05.33                       | 15.000.000               | EUR     | 16.505.253         | 0,39                         | UK (GOVT) 1,25 %<br>22.10.41      | 10.000.000               | GBP     | 7.925.419          | 0,19                         |
| FRANCE (GOVT) 3 %<br>25.10.54                       | 6.000.000                | EUR     | 6.136.577          | 0,14                         | UK (GOVT) 1,5 % 31.07.53          | 19.150.000               | GBP     | 12.774.275         | 0,30                         |
| FRANCE (GOVT) 3,5 %<br>25.11.33                     | 15.000.000               | EUR     | 17.144.579         | 0,40                         | UK (GOVT) 1,75 %<br>07/09/2037    | 4.499.000                | GBP     | 4.302.485          | 0,10                         |
| FRANCE (GOVT) 4 %<br>25.10.38                       | 1.763.000                | EUR     | 2.121.478          | 0,05                         | UK (GOVT) 3,5 % 22.10.25          | 35.500.000               | GBP     | 44.191.087         | 1,05                         |
| FRANCE (GOVT) 4,75 %<br>25.04.35                    | 3.000.000                | EUR     | 3.813.680          | 0,09                         | UK (GOVT) 3,75 %<br>29.01.38      | 12.500.000               | GBP     | 15.101.370         | 0,35                         |
|   |                          |         | <b>214.439.951</b> | <b>5,03</b>                  | UK (GOVT) 3,75 %<br>22.10.53      | 18.000.000               | GBP     | 20.295.923         | 0,48                         |
| <b>DEUTSCHLAND</b>                                  |                          |         |                    |                              | UK (GOVT) 4,25 %<br>07/06/2032    | 26.000.000               | GBP     | 33.897.261         | 0,80                         |
| BUNDESobligation 2,1 %<br>12/04/2029                | 25.000.000               | EUR     | 26.724.622         | 0,63                         | UK (GOVT) 4,25 %<br>07/09/2039    | 1.050.000                | GBP     | 1.328.806          | 0,03                         |
| BUNDESobligation 2,4 %<br>19.10.28                  | 10.000.000               | EUR     | 10.821.742         | 0,25                         | UK (GOVT) 4,25 %<br>07/12/2040    | 4.825.000                | GBP     | 6.070.286          | 0,14                         |
| BUNDESREPUBLIK<br>DEUTSCHLAND 2,3 %<br>15.02.33     | 18.000.000               | EUR     | 19.520.877         | 0,46                         | UK (GOVT) 4,375 %<br>31.07.54     | 9.000.000                | GBP     | 11.292.802         | 0,26                         |
| BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND<br>BUNDES 1,8 % 15.08.53 | 15.000.000               | EUR     | 14.047.561         | 0,33                         | UK (GOVT) 4,5 % 07.06.28          | 10.000.000               | GBP     | 12.911.896         | 0,30                         |
| BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND<br>BUNDES 2,4 % 15.11.30 | 10.000.000               | EUR     | 10.887.736         | 0,26                         | UK (GOVT) 4,625 %<br>31.01.34     | 22.000.000               | GBP     | 29.370.497         | 0,69                         |
| BUNDESSCHATZANWEISUN-<br>GEN 2,5 % 19.03.26         | 10.000.000               | EUR     | 10.729.451         | 0,25                         | <b>ITALIEN</b>                    |                          |         |                    |                              |
| BUNDESSCHATZANWEISUN-<br>GEN 2,8 % 12.06.25         | 20.000.000               | EUR     | 21.495.169         | 0,50                         | ITALY (GOVT) 0,95 %<br>15.09.27   | 15.000.000               | EUR     | 15.070.154         | 0,35                         |
| BUNDESSCHATZANWEISUN-<br>GEN 3,1 % 18.09.25         | 40.000.000               | EUR     | 43.213.936         | 1,01                         | ITALY (GOVT) 0,95 %<br>01/03/2037 | 2.500.000                | EUR     | 1.923.407          | 0,05                         |
| GERMANY (GOVT) 0 %<br>15.11.28                      | 23.500.000               | EUR     | 22.856.878         | 0,54                         | ITALY (GOVT) 1,8 %<br>01/03/2041  | 14.500.000               | EUR     | 11.486.647         | 0,27                         |
| GERMANY (GOVT) 0 %<br>15.05.36                      | 30.000.000               | EUR     | 24.381.050         | 0,57                         | ITALY (GOVT) 2,15 %<br>01/03/2072 | 2.000.000                | EUR     | 1.357.999          | 0,03                         |
| GERMANY (GOVT) 0 %<br>15.08.50                      | 10.000.000               | EUR     | 5.783.898          | 0,14                         | ITALY (GOVT) 2,25 %<br>01/09/2036 | 2.903.000                | EUR     | 2.663.552          | 0,06                         |
| GERMANY (GOVT) 0,4 %<br>13.09.24                    | 19.500.000               | EUR     | 20.759.095         | 0,49                         | ITALY (GOVT) 2,45 %<br>01/09/2050 | 7.500.000                | EUR     | 6.012.204          | 0,14                         |
| GERMANY (GOVT) 1 %<br>15.05.38                      | 10.000.000               | EUR     | 8.961.812          | 0,21                         | ITALY (GOVT) 2,65 %<br>01/12/2027 | 7.500.000                | EUR     | 7.974.555          | 0,19                         |
| GERMANY (GOVT) 2,5 %<br>13.03.25                    | 30.000.000               | EUR     | 32.142.724         | 0,75                         | ITALY (GOVT) 2,8 %<br>01/03/2067  | 400.000                  | EUR     | 327.041            | 0,01                         |
|   |                          |         | <b>272.326.551</b> | <b>6,39</b>                  | ITALY (GOVT) 3,5 %<br>15.01.26    | 15.000.000               | EUR     | 16.261.460         | 0,38                         |
| <b>GROSSBRITANNIEN</b>                              |                          |         |                    |                              | ITALY (GOVT) 3,5 %<br>15.02.31    | 10.000.000               | EUR     | 10.885.970         | 0,26                         |
| UK (GOVT) 0,125 % 31.01.28                          | 10.000.000               | GBP     | 10.969.015         | 0,26                         | ITALY (GOVT) 3,7 %<br>15.06.30    | 30.000.000               | EUR     | 33.103.479         | 0,77                         |
| UK (GOVT) 0,375 % 22.10.30                          | 9.000.000                | GBP     | 9.161.964          | 0,21                         | ITALY (GOVT) 3,75 %<br>01/09/2024 | 7.500.000                | EUR     | 8.099.742          | 0,19                         |
| UK (GOVT) 0,5 % 31.01.29                            | 15.000.000               | GBP     | 16.202.844         | 0,38                         |                                   |                          |         |                    |                              |
|   |                          |         |                    |                              |                                   |                          |         | <b>253.841.700</b> | <b>5,96</b>                  |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Government Bond (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung                       | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung                       | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------------------------------|--------------------------|---------|--------------------|------------------------------|------------------------------------|--------------------------|---------|--------------------|------------------------------|
| ITALY (GOVT) 3,8 %<br>01/08/2028   | 10.000.000               | EUR     | 11.078.413         | 0,26                         | JAPAN (GOVT) 0,5 %<br>20.12.41     | 3.500.000.000            | JPY     | 20.114.771         | 0,47                         |
| ITALY (GOVT) 3,85 %<br>15.09.26    | 10.000.000               | EUR     | 10.971.771         | 0,26                         | JAPAN (GOVT) 0,5 %<br>20.03.60     | 1.175.000.000            | JPY     | 5.112.915          | 0,12                         |
| ITALY (GOVT) 4,5 %<br>01/10/2053   | 10.500.000               | EUR     | 11.954.776         | 0,28                         | JAPAN (GOVT) 0,6 %<br>20.09.50     | 750.000.000              | JPY     | 3.824.307          | 0,09                         |
| ITALY (GOVT) 4,75 %<br>01/09/2028  | 4.310.000                | EUR     | 4.959.670          | 0,12                         | JAPAN (GOVT) 0,7 %<br>20.12.50     | 1.400.000.000            | JPY     | 7.315.987          | 0,17                         |
| ITALY (GOVT) 7,25 %<br>01/11/2026  | 3.000.000                | EUR     | 3.567.669          | 0,08                         | JAPAN (GOVT) 0,7 %<br>20.03.51     | 750.000.000              | JPY     | 3.903.530          | 0,09                         |
|                                    |                          |         | <b>157.698.509</b> | <b>3,70</b>                  | JAPAN (GOVT) 0,7 %<br>20.09.51     | 1.000.000.000            | JPY     | 5.171.664          | 0,12                         |
| <b>JAPAN</b>                       |                          |         |                    |                              | JAPAN (GOVT) 0,7 %<br>20.12.51     | 1.500.000.000            | JPY     | 7.730.759          | 0,18                         |
| JAPAN (GOVT) 0,005 %<br>01/12/2024 | 3.500.000.000            | JPY     | 23.122.835         | 0,54                         | JAPAN (GOVT) 1 %<br>20.03.62       | 1.000.000.000            | JPY     | 5.095.618          | 0,12                         |
| JAPAN (GOVT) 0,005 %<br>01/02/2025 | 2.000.000.000            | JPY     | 13.211.512         | 0,31                         | JAPAN (GOVT) 1,1 %<br>20.06.43     | 1.000.000.000            | JPY     | 6.264.572          | 0,15                         |
| JAPAN (GOVT) 0,005 %<br>01/06/2025 | 2.000.000.000            | JPY     | 13.205.434         | 0,31                         | JAPAN (GOVT) 1,2 %<br>20.06.53     | 1.500.000.000            | JPY     | 8.744.826          | 0,21                         |
| JAPAN (GOVT) 0,005 %<br>20.06.26   | 3.375.000.000            | JPY     | 22.211.163         | 0,52                         | JAPAN (GOVT) 1,3 %<br>20.12.43     | 2.000.000.000            | JPY     | 12.892.311         | 0,30                         |
| JAPAN (GOVT) 0,005 %<br>20.12.26   | 2.000.000.000            | JPY     | 13.146.969         | 0,31                         | JAPAN (GOVT) 1,3 %<br>20.06.52     | 300.000.000              | JPY     | 1.801.892          | 0,04                         |
| JAPAN (GOVT) 0,1 %<br>20.12.25     | 1.000.000.000            | JPY     | 6.601.817          | 0,15                         | JAPAN (GOVT) 1,3 %<br>20.03.63     | 1.750.000.000            | JPY     | 9.737.686          | 0,23                         |
| JAPAN (GOVT) 0,1 %<br>01/02/2026   | 2.500.000.000            | JPY     | 16.494.424         | 0,39                         | JAPAN (GOVT) 1,4 %<br>20.12.42     | 750.000.000              | JPY     | 4.969.221          | 0,12                         |
| JAPAN (GOVT) 0,1 %<br>20.06.26     | 2.265.000.000            | JPY     | 14.937.002         | 0,35                         | JAPAN (GOVT) 1,4 %<br>20.09.52     | 500.000.000              | JPY     | 3.072.253          | 0,07                         |
| JAPAN (GOVT) 0,1 %<br>20.09.27     | 3.000.000.000            | JPY     | 19.732.334         | 0,46                         | JAPAN (GOVT) 1,4 %<br>20.03.53     | 1.000.000.000            | JPY     | 6.128.836          | 0,14                         |
| JAPAN (GOVT) 0,1 %<br>20.06.28     | 5.000.000.000            | JPY     | 32.780.810         | 0,78                         | JAPAN (GOVT) 1,6 %<br>20.12.52     | 1.410.000.000            | JPY     | 9.072.903          | 0,21                         |
| JAPAN (GOVT) 0,1 %<br>20.03.30     | 3.600.000.000            | JPY     | 23.381.171         | 0,55                         | JAPAN (GOVT) 1,6 %<br>20.12.53     | 2.500.000.000            | JPY     | 15.992.021         | 0,38                         |
| JAPAN (GOVT) 0,2 %<br>20.12.27     | 2.500.000.000            | JPY     | 16.488.150         | 0,39                         | JAPAN (GOVT) 1,8 %<br>20.09.53     | 500.000.000              | JPY     | 3.354.961          | 0,08                         |
| JAPAN (GOVT) 0,2 %<br>20.03.28     | 5.000.000.000            | JPY     | 32.937.066         | 0,78                         | JAPAN (GOVT) 1,9 %<br>20.09.42     | 265.000.000              | JPY     | 1.903.337          | 0,04                         |
| JAPAN (GOVT) 0,2 %<br>20.12.28     | 4.000.000.000            | JPY     | 26.248.230         | 0,62                         |                                    |                          |         | <b>495.567.101</b> | <b>11,63</b>                 |
| JAPAN (GOVT) 0,3 %<br>20.12.25     | 995.000.000              | JPY     | 6.591.613          | 0,15                         | <b>MEXIKO</b>                      |                          |         |                    |                              |
| JAPAN (GOVT) 0,3 %<br>20.06.28     | 4.000.000.000            | JPY     | 26.443.409         | 0,62                         | MEXICAN (GOVT) 7,5 %<br>26.05.33   | 2.000.000                | MXN     | 10.758.011         | 0,25                         |
| JAPAN (GOVT) 0,3 %<br>20.12.28     | 2.500.000.000            | JPY     | 16.486.149         | 0,39                         | MEXICO (GOVT) 7,75 %<br>13.11.42   | 3.900.000                | MXN     | 20.031.392         | 0,47                         |
| JAPAN (GOVT) 0,4 %<br>20.09.28     | 1.500.000.000            | JPY     | 9.945.062          | 0,23                         |                                    |                          |         | <b>30.789.403</b>  | <b>0,72</b>                  |
| JAPAN (GOVT) 0,4 %<br>20.06.41     | 1.350.000.000            | JPY     | 7.692.783          | 0,18                         | <b>NIEDERLANDE</b>                 |                          |         |                    |                              |
| JAPAN (GOVT) 0,5 %<br>20.12.40     | 2.000.000.000            | JPY     | 11.704.798         | 0,27                         | NETHERLANDS (GOVT) 0 %<br>15.01.26 | 10.000.000               | EUR     | 10.264.887         | 0,24                         |
|                                    |                          |         |                    |                              | NETHERLANDS (GOVT) 0 %<br>15.01.27 | 10.000.000               | EUR     | 10.049.487         | 0,24                         |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Government Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung             | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung             | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------------|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|--------------------------|--------------------------|---------|--------------------|------------------------------|
| NETHERLANDS (GOVT) 0 %   |                          |         |                   |                              | SPAIN (GOVT) 4 %         |                          |         |                    |                              |
| 15.01.38                 | 7.500.000                | EUR     | 5.618.181         | 0,13                         | 31.10.54                 | 4.000.000                | EUR     | 4.487.879          | 0,11                         |
| NETHERLANDS (GOVT) 0 %   |                          |         |                   |                              | SPAIN (GOVT) 5,15 %      |                          |         |                    |                              |
| 15.01.52                 | 3.500.000                | EUR     | 1.871.327         | 0,04                         | 31.10.28                 | 8.020.000                | EUR     | 9.526.058          | 0,22                         |
| NETHERLANDS (GOVT)       |                          |         |                   |                              |                          |                          |         | <b>137.535.081</b> | <b>3,23</b>                  |
| 0,25 % 15.07.25          | 2.550.000                | EUR     | 2.656.303         | 0,06                         | <b>SCHWEDEN</b>          |                          |         |                    |                              |
| NETHERLANDS (GOVT) 0,5 % |                          |         |                   |                              | SWEDEN (GOVT) 1,75 %     |                          |         |                    |                              |
| 15.07.32                 | 2.500.000                | EUR     | 2.296.864         | 0,05                         | 11/11/2033               | 50.000.000               | SEK     | 4.440.378          | 0,10                         |
| NETHERLANDS (GOVT) 2 %   |                          |         |                   |                              |                          |                          |         | <b>4.440.378</b>   | <b>0,10</b>                  |
| 15.01.54                 | 3.000.000                | EUR     | 2.814.800         | 0,07                         | <b>USA</b>               |                          |         |                    |                              |
| NETHERLANDS (GOVT) 2,5 % |                          |         |                   |                              | US (GOVT) 2,625 %        |                          |         |                    |                              |
| 15.07.33                 | 10.000.000               | EUR     | 10.753.379        | 0,26                         | 15.02.29                 | 3.700.000                | USD     | 3.441.289          | 0,08                         |
| NETHERLANDS (GOVT) 4 %   |                          |         |                   |                              | US (GOVT) 3,375 %        |                          |         |                    |                              |
| 15.01.37                 | 2.550.000                | EUR     | 3.153.965         | 0,07                         | 15.05.33                 | 25.000.000               | USD     | 23.458.985         | 0,55                         |
|                          |                          |         | <b>49.479.193</b> | <b>1,16</b>                  | US (GOVT) 3,5 % 31.01.28 | 25.000.000               | USD     | 24.291.992         | 0,57                         |
| <b>NEUSEELAND</b>        |                          |         |                   |                              | US (GOVT) 3,5 % 31.01.30 | 10.000.000               | USD     | 9.633.203          | 0,23                         |
| NEW ZEALAND (GOVT)       |                          |         |                   |                              | US (GOVT) 3,5 % 15.02.33 | 27.000.000               | USD     | 25.609.922         | 0,60                         |
| 4,25 % 15.05.34          | 66.000.000               | NZD     | 38.401.562        | 0,90                         | US (GOVT) 3,625 %        |                          |         |                    |                              |
|                          |                          |         | <b>38.401.562</b> | <b>0,90</b>                  | 15.02.53                 | 20.000.000               | USD     | 17.621.875         | 0,41                         |
| <b>POLEN</b>             |                          |         |                   |                              | US (GOVT) 3,625 %        |                          |         |                    |                              |
| POLAND (GOVT) 3,625 %    |                          |         |                   |                              | 15.05.53                 | 25.000.000               | USD     | 22.039.063         | 0,52                         |
| 11/01/2034               | 10.000.000               | EUR     | 10.806.599        | 0,25                         | US (GOVT) 3,75 %         |                          |         |                    |                              |
| POLAND (GOVT) 3,875 %    |                          |         |                   |                              | 31.12.28                 | 10.000.000               | USD     | 9.798.047          | 0,23                         |
| 14.02.33                 | 17.695.000               | EUR     | 19.780.054        | 0,47                         | US (GOVT) 3,75 %         |                          |         |                    |                              |
|                          |                          |         | <b>30.586.653</b> | <b>0,72</b>                  | 30.06.30                 | 25.000.000               | USD     | 24.369.141         | 0,57                         |
| <b>SPANIEN</b>           |                          |         |                   |                              | US (GOVT) 3,75 %         |                          |         |                    |                              |
| SPAIN (GOVT) 0 %         |                          |         |                   |                              | 31.12.30                 | 28.000.000               | USD     | 27.258.438         | 0,64                         |
| 31.01.28                 | 27.500.000               | EUR     | 26.699.535        | 0,63                         | US (GOVT) 3,875 %        |                          |         |                    |                              |
| SPAIN (GOVT) 0,1 %       |                          |         |                   |                              | 15.08.33                 | 80.000.000               | USD     | 78.018.750         | 1,83                         |
| 30.04.31                 | 15.000.000               | EUR     | 13.339.720        | 0,31                         | US (GOVT) 3,875 %        |                          |         |                    |                              |
| SPAIN (GOVT) 0,7 %       |                          |         |                   |                              | 15.02.43                 | 17.500.000               | USD     | 16.229.883         | 0,38                         |
| 30.04.32                 | 10.000.000               | EUR     | 9.059.264         | 0,21                         | US (GOVT) 3,875 %        |                          |         |                    |                              |
| SPAIN (GOVT) 0,8 %       |                          |         |                   |                              | 15.05.43                 | 29.000.000               | USD     | 26.847.656         | 0,63                         |
| 30.07.29                 | 15.000.000               | EUR     | 14.593.962        | 0,34                         | US (GOVT) 4 % 15.01.2027 | 132.500.000              | USD     | 131.009.374        | 3,08                         |
| SPAIN (GOVT) 0,85 %      |                          |         |                   |                              | US (GOVT) 4 % 29.02.28   | 25.000.000               | USD     | 24.731.445         | 0,58                         |
| 30.07.37                 | 12.000.000               | EUR     | 9.488.088         | 0,22                         | US (GOVT) 4 % 31.01.29   | 45.000.000               | USD     | 44.583.399         | 1,05                         |
| SPAIN (GOVT) 1 %         |                          |         |                   |                              | US (GOVT) 4 % 31.01.31   | 10.000.000               | USD     | 9.882.031          | 0,23                         |
| 31.10.50                 | 5.000.000                | EUR     | 3.003.021         | 0,07                         | US (GOVT) 4 % 15.11.42   | 21.000.000               | USD     | 19.841.719         | 0,47                         |
| SPAIN (GOVT) 1,2 %       |                          |         |                   |                              | US (GOVT) 4,125 %        |                          |         |                    |                              |
| 31.10.40                 | 4.000.000                | EUR     | 3.074.680         | 0,07                         | 15.02.27                 | 65.000.000               | USD     | 64.502.344         | 1,51                         |
| SPAIN (GOVT) 1,45 %      |                          |         |                   |                              | US (GOVT) 4,125 %        |                          |         |                    |                              |
| 31.10.71                 | 2.000.000                | EUR     | 1.090.241         | 0,03                         | 31.10.27                 | 12.000.000               | USD     | 11.915.156         | 0,28                         |
| SPAIN (GOVT) 1,9 %       |                          |         |                   |                              | US (GOVT) 4,125 %        |                          |         |                    |                              |
| 31.10.52                 | 5.000.000                | EUR     | 3.710.025         | 0,09                         | 15.08.53                 | 59.000.000               | USD     | 56.898.125         | 1,33                         |
| SPAIN (GOVT) 3,25 %      |                          |         |                   |                              | US (GOVT) 4,25 %         |                          |         |                    |                              |
| 30.04.34                 | 10.000.000               | EUR     | 10.890.700        | 0,26                         | 31.01.26                 | 20.000.000               | USD     | 19.852.344         | 0,47                         |
| SPAIN (GOVT) 3,45 %      |                          |         |                   |                              | US (GOVT) 4,25 %         |                          |         |                    |                              |
| 30.07.43                 | 10.000.000               | EUR     | 10.557.630        | 0,25                         | 28.02.31                 | 25.000.000               | USD     | 25.076.172         | 0,59                         |
| SPAIN (GOVT) 3,45 %      |                          |         |                   |                              | US (GOVT) 4,25 %         |                          |         |                    |                              |
| 30.07.66                 | 1.290.000                | EUR     | 1.298.793         | 0,03                         | 15.02.54                 | 25.000.000               | USD     | 24.666.016         | 0,58                         |
| SPAIN (GOVT) 3,5 %       |                          |         |                   |                              | US (GOVT) 4,375 %        |                          |         |                    |                              |
| 31.05.29                 | 15.000.000               | EUR     | 16.715.485        | 0,39                         | 15.12.26                 | 27.500.000               | USD     | 27.453.809         | 0,64                         |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Government Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert             | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung             | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|----------------------|------------------------------|--------------------------|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|
| US (GOVT) 4,375 %   |                          |         |                      |                              | CANADA (GOVT) 1,25 %     |                          |         |                   |                              |
| 15.08.43  | 52.000.000               | USD     | 51.532.813           | 1,21                         | 01/06/2030               | 10.050.000               | CAD     | 6.535.163         | 0,15                         |
| US (GOVT) 4,5 % 15.11.33  | 70.000.000               | USD     | 71.667.969           | 1,68                         | CANADA (GOVT) 1,5 %      |                          |         |                   |                              |
| US (GOVT) 4,5 % 15.02.44  | 15.000.000               | USD     | 15.127.734           | 0,35                         | 01/05/2024               | 16.000.000               | CAD     | 11.791.078        | 0,28                         |
| US (GOVT) 4,625 %   |                          |         |                      |                              | CANADA (GOVT) 1,5 %      |                          |         |                   |                              |
| 30.06.25  | 30.000.000               | USD     | 29.902.148           | 0,70                         | 01/12/2031               | 5.000.000                | CAD     | 3.212.260         | 0,08                         |
| US (GOVT) 4,625 %   |                          |         |                      |                              | CANADA (GOVT) 1,75 %     |                          |         |                   |                              |
| 15.09.26  | 10.000.000               | USD     | 10.028.906           | 0,24                         | 01/12/2053               | 4.000.000                | CAD     | 2.078.816         | 0,05                         |
| US (GOVT) 4,625 %   |                          |         |                      |                              | CANADA (GOVT) 5,75 %     |                          |         |                   |                              |
| 30.09.28  | 85.000.000               | USD     | 86.301.562           | 2,03                         | 01/06/2029               | 2.250.000                | CAD     | 1.843.699         | 0,04                         |
| US (GOVT) 4,625 %   |                          |         |                      |                              |                          |                          |         | <b>42.650.872</b> | <b>1,00</b>                  |
| 30.09.30  | 45.000.000               | USD     | 46.042.383           | 1,08                         | <b>FRANKREICH</b>        |                          |         |                   |                              |
| US (GOVT) 4,75 %  |                          |         |                      |                              | FRANCE (GOVT) 0 %        |                          |         |                   |                              |
| 15.11.43  | 30.000.000               | USD     | 31.211.719           | 0,73                         | 25.02.27                 | 30.000.000               | EUR     | 29.953.706        | 0,70                         |
| US (GOVT) 4,75 %  |                          |         |                      |                              |                          |                          |         | <b>29.953.706</b> | <b>0,70</b>                  |
| 15.11.53  | 27.500.000               | USD     | 29.446.484           | 0,69                         | <b>ITALIEN</b>           |                          |         |                   |                              |
| US (GOVT) 4,875 %   |                          |         |                      |                              | ITALY (GOVT) 3,35 %      |                          |         |                   |                              |
| 30.11.25  | 30.000.000               | USD     | 30.059.766           | 0,71                         | 01/03/2035               | 4.000.000                | EUR     | 4.183.670         | 0,10                         |
| US (GOVT) 4,875 %   |                          |         |                      |                              | ITALY (GOVT) 4,75 %      |                          |         |                   |                              |
| 31.10.28  | 15.000.000               | USD     | 15.391.992           | 0,36                         | 01/09/2044               | 3.550.000                | EUR     | 4.190.785         | 0,10                         |
| US (GOVT) 4,875 %   |                          |         |                      |                              |                          |                          |         | <b>8.374.455</b>  | <b>0,20</b>                  |
| 31.10.30  | 10.000.000               | USD     | 10.376.563           | 0,24                         | <b>NIEDERLANDE</b>       |                          |         |                   |                              |
| US (GOVT) 5 % 30.09.25  | 80.000.000               | USD     | 80.226.562           | 1,88                         | NETHERLANDS (GOVT)       |                          |         |                   |                              |
| US (GOVT) 6,125 %   |                          |         |                      |                              | 0,25 % 15.07.29          | 3.000.000                | EUR     | 2.887.141         | 0,07                         |
| 15.11.27  | 9.000.000                | USD     | 9.545.625            | 0,22                         |                          |                          |         | <b>2.887.141</b>  | <b>0,07</b>                  |
|   |                          |         | <b>1.285.892.404</b> | <b>30,17</b>                 | <b>SCHWEDEN</b>          |                          |         |                   |                              |
| <b>SUMME ANLEIHEN</b>   |                          |         | <b>3.337.775.937</b> | <b>78,31</b>                 | SWEDEN (GOVT) 0,75 %     |                          |         |                   |                              |
| <b>SUMME DER AN EINER GEREGELTEN</b>                              |                          |         |                      |                              | 12/11/2029               | 31.000.000               | SEK     | 2.660.592         | 0,06                         |
| <b>BÖRSE NOTIERTEN WERTPAPIERE</b>                                |                          |         | <b>3.337.775.937</b> | <b>78,31</b>                 |                          |                          |         | <b>2.660.592</b>  | <b>0,06</b>                  |
| <b>WERTPAPIERE</b>  |                          |         |                      |                              | <b>USA</b>               |                          |         |                   |                              |
|   |                          |         |                      |                              | US (GOVT) 0,25 %         |                          |         |                   |                              |
| <b>AN EINEM ANDEREM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE, ÜBERTRAGBARE</b> |                          |         |                      |                              | 31.08.25                 | 7.000.000                | USD     | 6.566.738         | 0,15                         |
| <b>WERTPAPIERE</b>  |                          |         |                      |                              | US (GOVT) 0,375 %        |                          |         |                   |                              |
|   |                          |         |                      |                              | 31.12.25                 | 8.000.000                | USD     | 7.424.219         | 0,17                         |
| <b>ANLEIHEN</b>   |                          |         |                      |                              | US (GOVT) 0,375 %        |                          |         |                   |                              |
| <b>AUSTRALIEN</b>   |                          |         |                      |                              | 31.01.26                 | 75.000.000               | USD     | 69.380.860        | 1,63                         |
| AUSTRALIA (GOVT) 1 %  |                          |         |                      |                              | US (GOVT) 0,375 %        |                          |         |                   |                              |
| 21.12.30  | 14.000.000               | AUD     | 7.631.303            | 0,18                         | 31.07.27                 | 20.000.000               | USD     | 17.557.031        | 0,41                         |
| AUSTRALIA (GOVT) 1,25 %   |                          |         |                      |                              | US (GOVT) 0,5 % 28.02.26 | 84.500.000               | USD     | 78.145.995        | 1,84                         |
| 21.05.32  | 10.000.000               | AUD     | 5.322.235            | 0,12                         | US (GOVT) 0,5 % 31.08.27 | 15.000.000               | USD     | 13.188.281        | 0,31                         |
|   |                          |         | <b>12.953.538</b>    | <b>0,30</b>                  | US (GOVT) 0,75 %         |                          |         |                   |                              |
| <b>BELGIEN</b>  |                          |         |                      |                              | 31.03.26                 | 20.000.000               | USD     | 18.543.359        | 0,44                         |
| BELGIUM (GOVT) 0 %  |                          |         |                      |                              | US (GOVT) 0,875 %        |                          |         |                   |                              |
| 22.10.27  | 6.000.000                | EUR     | 5.902.616            | 0,14                         | 30.09.26                 | 50.000.000               | USD     | 45.792.969        | 1,07                         |
| BELGIUM (GOVT) 1 %  |                          |         |                      |                              | US (GOVT) 1,375 %        |                          |         |                   |                              |
| 22.06.31  | 4.076.000                | EUR     | 3.921.680            | 0,09                         | 15.11.40                 | 9.000.000                | USD     | 5.807.813         | 0,14                         |
|   |                          |         | <b>9.824.296</b>     | <b>0,23</b>                  | US (GOVT) 1,5 % 30.11.28 | 22.000.000               | USD     | 19.480.313        | 0,46                         |
| <b>KANADA</b>   |                          |         |                      |                              | US (GOVT) 1,875 %        |                          |         |                   |                              |
| CANADA (GOVT) 0,25 %  |                          |         |                      |                              | 28.02.27                 | 42.500.000               | USD     | 39.581.446        | 0,93                         |
| 01/03/2026  | 25.000.000               | CAD     | 17.189.856           | 0,40                         | US (GOVT) 1,875 %        |                          |         |                   |                              |
|   |                          |         |                      |                              | 15.02.41                 | 15.000.000               | USD     | 10.491.797        | 0,25                         |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Government Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung                                       | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert             | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--------------------------|---------|----------------------|------------------------------|
| US (GOVT) 2,375 %<br>15.02.42                      | 39.000.000               | USD     | 29.100.703           | 0,68                         |
| US (GOVT) 2,25 %<br>15.02.52                       | 50.000.000               | USD     | 33.007.813           | 0,77                         |
| US (GOVT) 2,875 %<br>15.05.28                      | 6.900.000                | USD     | 6.537.211            | 0,15                         |
| US (GOVT) 3,25 %<br>30.06.27                       | 15.000.000               | USD     | 14.499.609           | 0,34                         |
| US (GOVT) 3,25 %<br>30.06.29                       | 25.000.000               | USD     | 23.868.164           | 0,56                         |
| US (GOVT) 3,375 %<br>15.05.44                      | 24.910.000               | USD     | 21.327.242           | 0,50                         |
| US (GOVT) 3,75 %<br>31.05.30                       | 8.000.000                | USD     | 7.799.375            | 0,18                         |
| US (GOVT) 4 % 15.02.34                             | 50.000.000               | USD     | 49.253.907           | 1,16                         |
| US (GOVT) 4 % 15.11.52                             | 26.000.000               | USD     | 24.523.281           | 0,58                         |
| US (GOVT) 4,25 %<br>28.02.29                       | 40.000.000               | USD     | 40.092.188           | 0,94                         |
| US (GOVT) 4,5 % 15.02.36                           | 10.000.000               | USD     | 10.425.781           | 0,24                         |
| <b>SUMME ANLEIHEN</b>                              |                          |         | <b>592.396.095</b>   | <b>13,90</b>                 |
| <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN</b>                |                          |         | <b>701.700.695</b>   | <b>16,46</b>                 |
| <b>MARKT GEHANDELTEN ÜBERTRAGBAREN WERTPAPIERE</b> |                          |         | <b>701.700.695</b>   | <b>16,46</b>                 |
| <b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>           |                          |         |                      |                              |
| <b>IRLAND</b>                                      |                          |         |                      |                              |
| HSBC GLOBAL US DOLLAR<br>LIQUIDITY FUND „W“        | 2                        | USD     | 2                    | 0,00                         |
| HSBC US DOLLAR ESG<br>LIQUIDITY FUND Y INC         | 31.595.730               | USD     | 31.595.731           | 0,74                         |
|  |                          |         | <b>31.595.733</b>    | <b>0,74</b>                  |
| <b>LUXEMBURG</b>                                   |                          |         |                      |                              |
| HGIF BOND TOTAL RETURN<br>Z ACC                    | 13.370.000               | USD     | 159.450.620          | 3,74                         |
|  |                          |         | <b>159.450.620</b>   | <b>3,74</b>                  |
| <b>SUMME ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>     |                          |         | <b>191.046.353</b>   | <b>4,48</b>                  |
| <b>SUMME WERTPAPIERANLAGEN</b>                     |                          |         | <b>4.230.522.985</b> | <b>99,25</b>                 |
| <b>SONSTIGES NETTOVERMÖGEN</b>                     |                          |         | <b>32.005.531</b>    | <b>0,75</b>                  |
| <b>GESAMTNETTOVERMÖGEN</b>                         |                          |         | <b>4.262.528.516</b> | <b>100,00</b>                |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Green Bond

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung  | Nennwert  | Währung | Kurswert         | % des Nettovermögens | Beschreibung                | Nennwert | Währung | Kurswert | % des Nettovermögens |
|---|-----------|---------|------------------|----------------------|-----------------------------|----------|---------|----------|----------------------|
| <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>  |           |         |                  |                      | <b>FRANCE (GOVT) 0,5 %</b>  |          |         |          |                      |
| <b>AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |           |         |                  |                      | 25.06.44                    |          |         |          |                      |
| <b>ANLEIHEN</b>   |           |         |                  |                      | RTE RESEAU DE TRANSPORT     |          |         |          |                      |
| <b>BELGIEN</b>  |           |         |                  |                      | 0,75 % 12.01.34             |          |         |          |                      |
| BELGIUM (GOVT) 2,75 %   |           |         |                  |                      | RTE RESEAU DE TRANSPORT     |          |         |          |                      |
| 22.04.39  | 1.000.000 | EUR     | 1.036.168        | 1,67                 | 3,5 % 07.12.31              |          |         |          |                      |
| ELIA TRANSMISSION   |           |         |                  |                      | SNCF RESEAU 0,75 %          |          |         |          |                      |
| BELGIUM 3,625 % 18.01.33  | 400.000   | EUR     | 440.354          | 0,71                 | 25.05.36                    |          |         |          |                      |
| EUROPEAN UNION 0,40 %   |           |         |                  |                      | SOCIETE DES GRANDS PROJETS  |          |         |          |                      |
| 04/02/2037  | 1.900.000 | EUR     | 1.507.753        | 2,42                 | EPIC 3,5 % 25.06.49         |          |         |          |                      |
| EUROPEAN UNION 2,625 %  |           |         |                  |                      | SOCIETE DU GRAND PARIS      |          |         |          |                      |
| 04/02/2048  | 800.000   | EUR     | 787.697          | 1,27                 | 1 % 18.02.70                |          |         |          |                      |
| FLUVIUS SYSTEM OPERATOR   |           |         |                  |                      | SOCIETE DU GRAND PARIS      |          |         |          |                      |
| 0,25 % 02.12.30   | 500.000   | EUR     | 446.169          | 0,72                 | EPIC 1,125 % 22.10.28       |          |         |          |                      |
| KBC GROUP 3,75 % 27.03.2032                                       | 400.000   | EUR     | 437.425          | 0,70                 | SOCIETE GENERALE 0,875 %    |          |         |          |                      |
| PROXIMUS 4,125 % 17.11.2033                                       | 200.000   | EUR     | 226.399          | 0,36                 | VRN 22.09.28                |          |         |          |                      |
|   |           |         | <b>4.881.965</b> | <b>7,85</b>          | SOCIETE NATIONALE SNCF      |          |         |          |                      |
|   |           |         |                  |                      | 3,375 % 25.05.33            |          |         |          |                      |
|   |           |         |                  |                      | VINCI 0 % 27.11.28          |          |         |          |                      |
|   |           |         |                  |                      | <b>9.151.409</b>            |          |         |          |                      |
|   |           |         |                  |                      | <b>14,72</b>                |          |         |          |                      |
|   |           |         |                  |                      | <b>DEUTSCHLAND</b>          |          |         |          |                      |
|   |           |         |                  |                      | DEUTSCHE BANK 1,686 %       |          |         |          |                      |
|   |           |         |                  |                      | 19.03.26                    |          |         |          |                      |
|   |           |         |                  |                      | EUROGRID 1,113 % 15.05.2032 |          |         |          |                      |
|   |           |         |                  |                      | GERMANY (GOVT) 0 %          |          |         |          |                      |
|   |           |         |                  |                      | 15.08.50                    |          |         |          |                      |
|   |           |         |                  |                      | KREDITANSTALT FUER WIEDER-  |          |         |          |                      |
|   |           |         |                  |                      | AUFBAU 1,75 % 14.09.29      |          |         |          |                      |
|   |           |         |                  |                      | KREDITANSTALT FUER WIEDER-  |          |         |          |                      |
|   |           |         |                  |                      | AUFBAU 2,75 % 14.02.33      |          |         |          |                      |
|   |           |         |                  |                      | KREDITANSTALT FUER WIEDER-  |          |         |          |                      |
|   |           |         |                  |                      | AUFBAU 4,375 % 28.02.34     |          |         |          |                      |
|   |           |         |                  |                      | <b>6.752.977</b>            |          |         |          |                      |
|   |           |         |                  |                      | <b>10,87</b>                |          |         |          |                      |
|   |           |         |                  |                      | <b>GROSSBRITANNIEN</b>      |          |         |          |                      |
|   |           |         |                  |                      | NATIONAL GRID 3,875 %       |          |         |          |                      |
|   |           |         |                  |                      | 16.01.29                    |          |         |          |                      |
|   |           |         |                  |                      | SSE 1,375 % 04.09.27        |          |         |          |                      |
|   |           |         |                  |                      | VODAFONE GROUP 0,9 %        |          |         |          |                      |
|   |           |         |                  |                      | 24.11.26                    |          |         |          |                      |
|   |           |         |                  |                      | <b>2.075.154</b>            |          |         |          |                      |
|   |           |         |                  |                      | <b>3,34</b>                 |          |         |          |                      |
|   |           |         |                  |                      | <b>IRLAND</b>               |          |         |          |                      |
|   |           |         |                  |                      | AIB GROUP 5,25 % VRN        |          |         |          |                      |
|   |           |         |                  |                      | 23.10.31                    |          |         |          |                      |
|   |           |         |                  |                      | BANK OF IRELAND 4,625 %     |          |         |          |                      |
|   |           |         |                  |                      | VRN 13.11.29                |          |         |          |                      |
|   |           |         |                  |                      | <b>680.658</b>              |          |         |          |                      |
|   |           |         |                  |                      | <b>1,09</b>                 |          |         |          |                      |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Green Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung                | Nennwert  | Währung | Kurswert         | % des Nettovermögens | Beschreibung               | Nennwert | Währung | Kurswert         | % des Nettovermögens |
|-----------------------------|-----------|---------|------------------|----------------------|----------------------------|----------|---------|------------------|----------------------|
| <b>ITALIEN</b>              |           |         |                  |                      | TELEFONICA EUROPE          |          |         |                  |                      |
| ASSICURAZIONI GENERALI      |           |         |                  |                      | 6,135 % VRN PERP           | 300.000  | EUR     | 336.580          | 0,54                 |
| 2,429 % 14.07.31            | 700.000   | EUR     | 673.498          | 1,08                 | TENNET HOLDING 2 %         |          |         |                  |                      |
| ITALY (GOVT) 1,50 %         |           |         |                  |                      | 05/06/2034                 | 490.000  | EUR     | 479.212          | 0,77                 |
| 30.04.45                    | 400.000   | EUR     | 279.996          | 0,45                 | TENNET HOLDING 4,75 %      |          |         |                  |                      |
| ITALY (GOVT) 4 %            |           |         |                  |                      | 28.10.42                   | 250.000  | EUR     | 311.441          | 0,50                 |
| 30.10.31                    | 1.500.000 | EUR     | 1.687.098        | 2,72                 |                            |          |         | <b>7.234.883</b> | <b>11,64</b>         |
| UNICREDIT 0,8 % VRN         |           |         |                  |                      | <b>NORWEGEN</b>            |          |         |                  |                      |
| 05/07/2029                  | 600.000   | EUR     | 580.097          | 0,93                 | DNB BANK 4,625 % VRN       |          |         |                  |                      |
|                             |           |         | <b>3.220.689</b> | <b>5,18</b>          | 01/11/2029                 | 322.000  | EUR     | 362.633          | 0,58                 |
| <b>JAPAN</b>                |           |         |                  |                      | STATKRAFT 2,875 %          |          |         |                  |                      |
| NTT FINANCE 3,359 %         |           |         |                  |                      | 13.09.29                   | 400.000  | EUR     | 425.840          | 0,69                 |
| 12/03/2031                  | 500.000   | EUR     | 543.842          | 0,87                 | STATKRAFT 3,5 % 09.06.2033 | 159.000  | EUR     | 174.712          | 0,28                 |
|                             |           |         | <b>543.842</b>   | <b>0,87</b>          |                            |          |         | <b>963.185</b>   | <b>1,55</b>          |
| <b>LUXEMBURG</b>            |           |         |                  |                      | <b>PHILIPPINEN</b>         |          |         |                  |                      |
| EUROPEAN INVESTMENT         |           |         |                  |                      | ASIAN DEVELOPMENT BANK     |          |         |                  |                      |
| BANK 1 % 14.11.42           | 500.000   | EUR     | 387.837          | 0,62                 | 1,75 % 14.08.26            | 563.000  | USD     | 527.896          | 0,85                 |
| EUROPEAN INVESTMENT         |           |         |                  |                      | ASIAN DEVELOPMENT BANK     |          |         |                  |                      |
| BANK 1,5 % 15.11.47         | 1.130.000 | EUR     | 914.876          | 1,47                 | 2,55 % 10.01.31            | 600.000  | EUR     | 641.412          | 1,03                 |
| EUROPEAN INVESTMENT         |           |         |                  |                      |                            |          |         | <b>1.169.308</b> | <b>1,88</b>          |
| BANK 1,625 % 13.05.31       | 1.000.000 | USD     | 840.660          | 1,35                 | <b>PORTUGAL</b>            |          |         |                  |                      |
| EUROPEAN INVESTMENT         |           |         |                  |                      | EDP ENERGIAS DE PORTUGAL   |          |         |                  |                      |
| BANK 3,75 % 14.02.33        | 2.000.000 | USD     | 1.921.055        | 3,10                 | 1,875 % VRN 02.08.81       | 400.000  | EUR     | 406.265          | 0,65                 |
|                             |           |         | <b>4.064.428</b> | <b>6,54</b>          | EDP ENERGIAS DE PORTUGAL   |          |         |                  |                      |
| <b>NIEDERLANDE</b>          |           |         |                  |                      | 5,943 % VRN 23.04.83       | 400.000  | EUR     | 452.139          | 0,73                 |
| ABN AMRO BANK 0,5 %         |           |         |                  |                      |                            |          |         | <b>858.404</b>   | <b>1,38</b>          |
| 23.09.29                    | 400.000   | EUR     | 370.242          | 0,60                 | <b>SPANIEN</b>             |          |         |                  |                      |
| ALLIANDER 3,25 % 13.06.2028 | 500.000   | EUR     | 543.674          | 0,87                 | BANCO BILBAO VIZCAYA       |          |         |                  |                      |
| ASR NEDERLAND 3,625 %       |           |         |                  |                      | ARGENTARIA 3,5 % 26.03.31  | 300.000  | EUR     | 325.611          | 0,52                 |
| 12/12/2028                  | 424.000   | EUR     | 459.165          | 0,74                 | BANCO BILBAO VIZCAYA       |          |         |                  |                      |
| COOPERATIEVE RABOBANK       |           |         |                  |                      | ARGENTARIA 4,375 %         |          |         |                  |                      |
| 1,106 % VRN 24.02.27        | 1.000.000 | USD     | 921.545          | 1,48                 | 14.10.29                   | 800.000  | EUR     | 908.565          | 1,47                 |
| ENEL FINANCE INTERNATIONAL  |           |         |                  |                      | BANCO SANTANDER 0,3 %      |          |         |                  |                      |
| 1,125 % 16.09.26            | 500.000   | EUR     | 512.332          | 0,82                 | 04/10/2026                 | 500.000  | EUR     | 500.407          | 0,80                 |
| ENEXIS HOLDING 0,375 %      |           |         |                  |                      | CAIXABANK 4,125 % VRN      |          |         |                  |                      |
| 14.04.33                    | 700.000   | EUR     | 594.539          | 0,96                 | 09/02/2032                 | 300.000  | EUR     | 329.180          | 0,53                 |
| HM FINANCE 4,875 %          |           |         |                  |                      | IBERDROLA FINANZAS         |          |         |                  |                      |
| 25.10.31                    | 193.000   | EUR     | 221.453          | 0,36                 | 4,875 % VRN PERP           | 500.000  | EUR     | 548.768          | 0,89                 |
| ING GROEP 4 % VRN           |           |         |                  |                      | SPAIN (GOVT) 1 %           |          |         |                  |                      |
| 12/02/2035                  | 600.000   | EUR     | 661.942          | 1,06                 | 30.07.42                   | 600.000  | EUR     | 429.590          | 0,69                 |
| KONINKLIJKE AHOLD           |           |         |                  |                      | TELEFONICA EMISIONES       |          |         |                  |                      |
| DELHAIZE 3,5 % 04.04.28     | 410.000   | EUR     | 447.797          | 0,72                 | 4,183 % 21.11.33           | 400.000  | EUR     | 449.330          | 0,72                 |
| NATIONALENEDERLANDEN        |           |         |                  |                      |                            |          |         | <b>3.491.451</b> | <b>5,62</b>          |
| BANK 0,5 % 21.09.28         | 300.000   | EUR     | 285.773          | 0,46                 | <b>SCHWEDEN</b>            |          |         |                  |                      |
| NEDERLANDSE WATERSCHAPSBANK |           |         |                  |                      | SKANDINAVISKA ENSKILDA     |          |         |                  |                      |
| 0 % 02.10.34                | 400.000   | EUR     | 320.364          | 0,52                 | BANKEN 4,125 % 29.06.27    | 500.000  | EUR     | 553.081          | 0,89                 |
| NEDERLANDSE                 |           |         |                  |                      |                            |          |         | <b>553.081</b>   | <b>0,89</b>          |
| WATERSCHAPSBANK             |           |         |                  |                      |                            |          |         |                  |                      |
| 3 % 20.04.33                | 700.000   | EUR     | 768.824          | 1,24                 |                            |          |         |                  |                      |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Green Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung   | Nennwert  | Währung | Kurswert          | % des Nettovermögens | Beschreibung   | Nennwert | Währung | Kurswert          | % des Nettovermögens |
|--|-----------|---------|-------------------|----------------------|--|----------|---------|-------------------|----------------------|
| <b>USA</b>   |           |         |                   |                      | <b>SCHWEDEN</b>                                      |          |         |                   |                      |
| APPLE 3 % 20.06.27   | 1.000.000 | USD     | 953.989           | 1,54                 | SVENSKA HANDELSBANKEN                                |          |         |                   |                      |
| BANK OF AMERICA 4,134 %<br>12/06/2028                            | 500.000   | EUR     | 554.683           | 0,89                 | 2,625 % 05.09.29                                     | 800.000  | EUR     | 842.033           | 1,35                 |
| JPMORGAN CHASE 6,07 %<br>VRN 22.10.27                            | 500.000   | USD     | 510.611           | 0,82                 | TELIA 1,375 % VRN<br>11/05/2081                      | 500.000  | EUR     | 508.961           | 0,82                 |
| PROLOGIS EURO FINANCE<br>0,375 % 06.02.28                        | 300.000   | EUR     | 288.670           | 0,46                 |  |          |         | <b>1.350.994</b>  | <b>2,17</b>          |
|  |           |         | <b>2.307.953</b>  | <b>3,71</b>          | <b>USA</b>   |          |         |                   |                      |
| <b>SUMME ANLEIHEN</b>  |           |         | <b>49.949.438</b> | <b>80,34</b>         | ALEXANDRIA REAL ESTATE                               |          |         |                   |                      |
| <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN</b>                              |           |         |                   |                      | EQUITIES 3,8 % 15.04.26                              | 230.000  | USD     | 223.806           | 0,36                 |
| <b>BÖRSE NOTIERTEN WERTPAPIERE</b>                               |           |         | <b>49.949.438</b> | <b>80,34</b>         | BANK OF AMERICA 2,456 %<br>VRN 22.10.25              | 500.000  | USD     | 491.179           | 0,79                 |
| <b>WERTPAPIERE</b>   |           |         |                   |                      | CONSOLIDATED EDISON OF<br>NEW YORK 3,95 % 01.04.2050 | 500.000  | USD     | 408.346           | 0,66                 |
|  |           |         |                   |                      | EQUINIX 1 % 15.03.33                                 | 400.000  | EUR     | 344.125           | 0,55                 |
| <b>AN EINEM ANDEREM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE, ÜBERTRAGBARE</b> |           |         |                   |                      | METROPOLITAN LIFE GLOBAL<br>FUNDING 0,95 % 02.07.25  | 800.000  | USD     | 759.229           | 1,23                 |
| <b>WERTPAPIERE</b>   |           |         |                   |                      | PRUDENTIAL FINANCIAL<br>1,5 % 10.03.26               | 700.000  | USD     | 655.762           | 1,05                 |
| <b>ANLEIHEN</b>  |           |         |                   |                      | TOYOTA MOTOR CREDIT<br>2,15 % 13.02.30               | 600.000  | USD     | 520.042           | 0,84                 |
| <b>KANADA</b>  |           |         |                   |                      | VERIZON COMMUNICATIONS<br>2,85 % 03.09.41            | 700.000  | USD     | 505.706           | 0,81                 |
| CANADIAN IMPERIAL BANK<br>OF COMMER 0,95 % 23.10.2025            | 900.000   | USD     | 845.685           | 1,36                 |  |          |         | <b>3.908.195</b>  | <b>6,29</b>          |
|  |           |         | <b>845.685</b>    | <b>1,36</b>          | <b>SUMME ANLEIHEN</b>                                |          |         | <b>11.182.616</b> | <b>17,99</b>         |
| <b>FRANKREICH</b>  |           |         |                   |                      | <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN</b>                  |          |         | <b>11.182.616</b> | <b>17,99</b>         |
| AXA 1,375 % VRN 07.10.2041                                       | 800.000   | EUR     | 722.464           | 1,16                 | <b>MARKT GEHANDELTEN ÜBERTRAGBAREN WERTPAPIERE</b>   |          |         | <b>61.132.054</b> | <b>98,33</b>         |
| BNP PARIBAS 1,675 % VRN<br>30.06.27                              | 1.200.000 | USD     | 1.106.987         | 1,79                 | <b>SUMME WERTPAPIERANLAGEN</b>                       |          |         | <b>1.040.074</b>  | <b>1,67</b>          |
| CREDIT AGRICOLE 0,375 %<br>21.10.25                              | 800.000   | EUR     | 823.485           | 1,32                 | <b>SONSTIGES NETTOVERMÖGEN</b>                       |          |         | <b>62.172.128</b> | <b>100,00</b>        |
|  |           |         | <b>2.652.936</b>  | <b>4,27</b>          | <b>GESAMTNETTOVERMÖGEN</b>                           |          |         |                   |                      |
| <b>DEUTSCHLAND</b>   |           |         |                   |                      |  |          |         |                   |                      |
| DEUTSCHE WOHNEN 1,3 %<br>07/04/2041                              | 200.000   | EUR     | 141.455           | 0,23                 |  |          |         |                   |                      |
| EON 4,125 % 25.03.44   | 500.000   | EUR     | 554.028           | 0,89                 |  |          |         |                   |                      |
| MUENCHENER RUECKVERSICHERUN<br>5,875 % VRN 23.05.42              | 400.000   | USD     | 406.663           | 0,65                 |  |          |         |                   |                      |
|  |           |         | <b>1.102.146</b>  | <b>1,77</b>          |  |          |         |                   |                      |
| <b>LUXEMBURG</b>   |           |         |                   |                      |  |          |         |                   |                      |
| SEGRO CAPITAL 0,5 %<br>22.09.31                                  | 230.000   | EUR     | 196.873           | 0,32                 |  |          |         |                   |                      |
|  |           |         | <b>196.873</b>    | <b>0,32</b>          |  |          |         |                   |                      |
| <b>NIEDERLANDE</b>   |           |         |                   |                      |  |          |         |                   |                      |
| CTP 1,25 % 21.06.29  | 340.000   | EUR     | 317.511           | 0,51                 |  |          |         |                   |                      |
| DIGITAL DUTCH FINCO 1 %<br>15.01.32                              | 250.000   | EUR     | 214.646           | 0,35                 |  |          |         |                   |                      |
| ING GROEP 4,625 %<br>06/01/2026                                  | 600.000   | USD     | 593.630           | 0,95                 |  |          |         |                   |                      |
|  |           |         | <b>1.125.787</b>  | <b>1,81</b>          |  |          |         |                   |                      |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global High Income Bond

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert  | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert  | % des<br>Netto-<br>vermögens |  |
|---|--------------------------|---------|-----------|------------------------------|--|--------------------------|---------|-----------|------------------------------|--|
| <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>  |                          |         |           |                              | <b>EMPRESA NACIONAL DEL PETROLEO 6,15 % 10.05.33</b> |                          |         |           |                              |  |
| <b>AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |                          |         |           |                              |  |                          |         |           |                              |  |
| <b>ANLEIHEN</b>   |                          |         |           |                              | <b>CHINA</b>   |                          |         |           |                              |  |
| <b>ARGENTINIEN</b>  |                          |         |           |                              | ALIBABA GROUP HOLDING                                |                          |         |           |                              |  |
| ARGENTINA (GOVT) 0,125 %<br>09/07/2035                            | 5.975.755                | USD     | 2.539.696 | 0,29                         | 3,4 % 06.12.27                                       | 200.000                  | USD     | 189.456   | 0,02                         |  |
|   |                          |         |           |                              | ALIBABA GROUP HOLDING                                |                          |         |           |                              |  |
|   |                          |         |           |                              | 4,4 % 06.12.57                                       |                          |         |           |                              |  |
|   |                          |         |           |                              | CHINA AOYUAN 6,2 %<br>24.03.26                       |                          |         |           |                              |  |
|   |                          |         |           |                              | 1.200.000  |                          |         |           |                              |  |
|   |                          |         |           |                              | USD  |                          |         |           |                              |  |
|   |                          |         |           |                              | 24.000   |                          |         |           |                              |  |
|   |                          |         |           |                              | USD  |                          |         |           |                              |  |
|   |                          |         |           |                              | 0,00   |                          |         |           |                              |  |
|   |                          |         |           |                              | CHINA AOYUAN 6,35 %<br>08.02.24*                     |                          |         |           |                              |  |
|   |                          |         |           |                              | 600.000  |                          |         |           |                              |  |
|   |                          |         |           |                              | USD  |                          |         |           |                              |  |
|   |                          |         |           |                              | 13.500   |                          |         |           |                              |  |
|   |                          |         |           |                              | USD  |                          |         |           |                              |  |
|   |                          |         |           |                              | 0,00   |                          |         |           |                              |  |
| <b>ÖSTERREICH</b>   |                          |         |           |                              | CHINA SCE GROUP                                      |                          |         |           |                              |  |
| ERSTE GROUP BANK 0,875 %<br>VRN 15.11.2032                        | 2.500.000                | EUR     | 2.396.049 | 0,27                         | HOLDINGS 7,375 % 09.04.24                            | 200.000                  | USD     | 12.579    | 0,00                         |  |
|   |                          |         |           |                              | 2.396.049  |                          |         |           |                              |  |
|   |                          |         |           |                              | 0,27   |                          |         |           |                              |  |
| <b>ASERBAIDSCHAN</b>  |                          |         |           |                              | COUNTRY GARDEN HOLDINGS                              |                          |         |           |                              |  |
| AZERBAIJAN (GOVT) 3,5 %<br>01/09/2032                             | 1.430.000                | USD     | 1.216.678 | 0,14                         | 5,125 % 14.01.27                                     | 750.000                  | USD     | 52.658    | 0,01                         |  |
|   |                          |         |           |                              | 1.216.678  |                          |         |           |                              |  |
|   |                          |         |           |                              | 0,14   |                          |         |           |                              |  |
| <b>BELGIEN</b>  |                          |         |           |                              | COUNTRY GARDEN HOLDINGS                              |                          |         |           |                              |  |
| ELIA GROUP 5,85 % VRN PERP  | 1.700.000                | EUR     | 1.894.033 | 0,21                         | 6,15 % 17.09.25                                      | 1.200.000                | USD     | 82.988    | 0,01                         |  |
| ELIA TRANSMISSION   | 1.500.000                | EUR     | 1.639.815 | 0,19                         | INDUSTRIAL COMMERCIAL BANK OF                        | 200.000                  | USD     | 198.120   | 0,02                         |  |
| BELGIUM 3,75 % 16.01.2036   | 3.000.000                | EUR     | 3.286.180 | 0,37                         | MUTUEL 4,5 % 19.01.26                                | 300.000                  | USD     | 24.281    | 0,00                         |  |
| KBC GROUP 4,75 % VRN  | 700.000                  | EUR     | 792.397   | 0,09                         | KWG GROUP HOLDINGS                                   | 500.000                  | USD     | 49.057    | 0,01                         |  |
| 17.04.35  |                          |         |           |                              |  | 7,875 % 30.08.24         |         |           |                              |  |
| PROXIMUS 4,125 %  |                          |         |           |                              |  | LOGAN PROPERTY HOLDINGS  |         |           |                              |  |
| 17.11.33  |                          |         |           |                              |  | 7,5 % 25.08.2022**       |         |           |                              |  |
|   |                          |         |           |                              | 500.000  |                          |         |           |                              |  |
|   |                          |         |           |                              | USD  |                          |         |           |                              |  |
|   |                          |         |           |                              | 49.057   |                          |         |           |                              |  |
|   |                          |         |           |                              | USD  |                          |         |           |                              |  |
|   |                          |         |           |                              | 0,01   |                          |         |           |                              |  |
| <b>BERMUDA</b>  |                          |         |           |                              | SHIMAO PROPERTY HOLDINGS                             |                          |         |           |                              |  |
| CBQ FINANCE 5,375 %   | 3.100.000                | USD     | 3.089.556 | 0,35                         | 6,125 % 21.02.2024***                                | 200.000                  | USD     | 7.513     | 0,00                         |  |
| 28.03.29  |                          |         |           |                              |  | 2.365.000                |         |           |                              |  |
|   |                          |         |           |                              | USD  |                          |         |           |                              |  |
|   |                          |         |           |                              | 72.245   |                          |         |           |                              |  |
|   |                          |         |           |                              | USD  |                          |         |           |                              |  |
|   |                          |         |           |                              | 0,00   |                          |         |           |                              |  |
| <b>BRASILIEN</b>  |                          |         |           |                              | ZHENRO PROPERTIES GROUP                              |                          |         |           |                              |  |
| BRAZIL (GOVT) 7,125 %   | 1.200.000                | USD     | 1.211.119 | 0,14                         | 6,63 % 07.01.26                                      | 800.000                  | USD     | 10.904    | 0,00                         |  |
| 13.05.54  |                          |         |           |                              |  | 1.211.119                |         |           |                              |  |
|   |                          |         |           |                              | 0,14   |                          |         |           |                              |  |
| <b>KANADA</b>   |                          |         |           |                              | ZHENRO PROPERTIES GROUP                              |                          |         |           |                              |  |
| ALIMENTATION COUCHE   | 1.053.000                | EUR     | 1.141.943 | 0,13                         | 7,1 % 10.09.24                                       | 200.000                  | USD     | 2.633     | 0,00                         |  |
| 3,647 % 12.05.31  |                          |         |           |                              |  | 990.312                  |         |           |                              |  |
| NOVA CHEMICALS 8,5 %  | 4.307.000                | USD     | 4.590.758 | 0,52                         |  |                          |         |           |                              |  |
| 15.11.28  |                          |         |           |                              |  | 0,11                     |         |           |                              |  |
|   |                          |         |           |                              | 0,65   |                          |         |           |                              |  |
| <b>CHILE</b>  |                          |         |           |                              | <b>KOLUMBIEN</b>                                     |                          |         |           |                              |  |
| CORP NACIONAL DEL COBRE   | 1.825.000                | USD     | 1.736.246 | 0,19                         | BANCOLOMBIA 4,625 % VRN                              | 1.500.000                | USD     | 1.463.819 | 0,17                         |  |
| 5,125 % 02.02.33  |                          |         |           |                              |  | 18.12.29                 |         |           |                              |  |
| CORP NACIONAL DEL COBRE   | 1.200.000                | USD     | 1.202.933 | 0,14                         | COLOMBIA (GOVT) 6,125 %                              | 730.000                  | USD     | 633.535   | 0,07                         |  |
| 5,95 % 08.01.34   |                          |         |           |                              |  | 18.01.41                 |         |           |                              |  |
| CORP NACIONAL DEL COBRE   | 1.300.000                | USD     | 1.294.521 | 0,15                         | COLOMBIA (GOVT) 8 %                                  | 500.000                  | USD     | 526.591   | 0,06                         |  |
| DE CHILE 6,3 % 08.09.53   |                          |         |           |                              |  | 14.11.35                 |         |           |                              |  |
| CORP NACIONAL DEL COBRE   | 670.000                  | USD     | 692.709   | 0,08                         | COLOMBIA (GOVT) 8,75 %                               | 1.500.000                | USD     | 1.632.757 | 0,18                         |  |
| DE CHILE 6,44 % 26.01.36  |                          |         |           |                              |  | 14.11.53                 |         |           |                              |  |
|   |                          |         |           |                              | ECOPETROL 5,875 %                                    |                          |         |           |                              |  |
|   |                          |         |           |                              | 28.05.45   |                          |         |           |                              |  |
|   |                          |         |           |                              | 430.000  |                          |         |           |                              |  |
|   |                          |         |           |                              | USD  |                          |         |           |                              |  |
|   |                          |         |           |                              | 321.561  |                          |         |           |                              |  |
|   |                          |         |           |                              | USD  |                          |         |           |                              |  |
|   |                          |         |           |                              | 0,04   |                          |         |           |                              |  |
|   |                          |         |           |                              | ECOPETROL 8,375 %                                    |                          |         |           |                              |  |
|   |                          |         |           |                              | 19.01.36   |                          |         |           |                              |  |
|   |                          |         |           |                              | 410.000  |                          |         |           |                              |  |
|   |                          |         |           |                              | USD  |                          |         |           |                              |  |
|   |                          |         |           |                              | 413.286  |                          |         |           |                              |  |
|   |                          |         |           |                              | USD  |                          |         |           |                              |  |
|   |                          |         |           |                              | 0,05   |                          |         |           |                              |  |
|   |                          |         |           |                              | ECOPETROL 8,625 %                                    |                          |         |           |                              |  |
|   |                          |         |           |                              | 19.01.29   |                          |         |           |                              |  |
|   |                          |         |           |                              | 1.590.000  |                          |         |           |                              |  |
|   |                          |         |           |                              | USD  |                          |         |           |                              |  |
|   |                          |         |           |                              | 1.686.207  |                          |         |           |                              |  |
|   |                          |         |           |                              | USD  |                          |         |           |                              |  |
|   |                          |         |           |                              | 0,18   |                          |         |           |                              |  |
|   |                          |         |           |                              | ECOPETROL 8,875 %                                    |                          |         |           |                              |  |
|   |                          |         |           |                              | 13.01.33   |                          |         |           |                              |  |
|   |                          |         |           |                              | 325.000  |                          |         |           |                              |  |
|   |                          |         |           |                              | USD  |                          |         |           |                              |  |
|   |                          |         |           |                              | 344.429  |                          |         |           |                              |  |
|   |                          |         |           |                              | USD  |                          |         |           |                              |  |
|   |                          |         |           |                              | 0,04   |                          |         |           |                              |  |
|   |                          |         |           |                              | 7.022.185  |                          |         |           |                              |  |
|   |                          |         |           |                              | 0,79   |                          |         |           |                              |  |

\* Der Vermögenswert, der am 8. Februar 2024 fällig war, ist notleidend. Der Ausschuss für die Preisbestimmung die und Verwaltungsgesellschaft haben vereinbart, den letzten am Markt verfügbaren Preis zu verwenden.

\*\* Der Vermögenswert, der am 25. August 2022 fällig war, ist notleidend. Der Ausschuss für die Preisbestimmung die und Verwaltungsgesellschaft haben vereinbart, den letzten am Markt verfügbaren Preis zu verwenden.

\*\*\* Der Vermögenswert, der am 21. Februar 2024 fällig war, ist notleidend. Der Ausschuss für die Preisbestimmung die und Verwaltungsgesellschaft haben vereinbart, den letzten am Markt verfügbaren Preis zu verwenden.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global High Income Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung                   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung                      | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------------------|--------------------------|---------|------------------|------------------------------|-----------------------------------|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|
| <b>DÄNEMARK</b>                |                          |         |                  |                              | <b>CREDIT AGRICOLE ASSURANCES</b> |                          |         |                   |                              |
| JYSKE BANK 5,125 % VRN         |                          |         |                  |                              | 4,75 % VRN 27.09.48               | 2.000.000                | EUR     | 2.206.597         | 0,25                         |
| 01/05/2035                     | 2.500.000                | EUR     | 2.761.331        | 0,31                         | CREDIT MUTUEL ARKEA               |                          |         |                   |                              |
| TDC NET 6,5 % 01.06.2031       | 2.500.000                | EUR     | 2.918.877        | 0,33                         | 3,875 % 22.05.28                  | 400.000                  | EUR     | 439.860           | 0,05                         |
|                                |                          |         | <b>5.680.208</b> | <b>0,64</b>                  | <b>CROWN EUROPEAN HOLDINGS</b>    |                          |         |                   |                              |
| <b>DOMINIKANISCHE REPUBLIK</b> |                          |         |                  |                              | 4,75 % 15.03.29                   |                          |         |                   |                              |
| DOMINIKANISCHE REPUBLIK        |                          |         |                  |                              | ELIS 3,75 % 21.03.30              | 1.950.000                | EUR     | 2.140.917         | 0,24                         |
| (GOVT) 7,05 % 03.02.31         | 850.000                  | USD     | 881.849          | 0,10                         | FRANCE (GOVT) 1,75 %              | 900.000                  | EUR     | 969.522           | 0,11                         |
|                                |                          |         | <b>881.849</b>   | <b>0,10</b>                  | 25.11.24                          | 4.000.000                | EUR     | 4.269.041         | 0,48                         |
| <b>ÄGYPTEN</b>                 |                          |         |                  |                              | INDIGO GROUP 4,5 %                |                          |         |                   |                              |
| EGYPT (GOVT) 7,625 %           |                          |         |                  |                              | 18.04.30                          | 2.000.000                | EUR     | 2.247.978         | 0,25                         |
| 29.05.32                       | 500.000                  | USD     | 427.275          | 0,05                         | LA POSTE 3,125 % VRN PERP         | 2.000.000                | EUR     | 2.102.526         | 0,24                         |
| EGYPT (GOVT) 8,50 %            |                          |         |                  |                              | NEXANS 4,25 % 11.03.30            | 1.200.000                | EUR     | 1.306.552         | 0,15                         |
| 31.01.47                       | 2.000.000                | USD     | 1.592.342        | 0,18                         | ORANGE 1,375 % VRN PERP           | 2.000.000                | EUR     | 1.861.188         | 0,21                         |
|                                |                          |         | <b>2.019.617</b> | <b>0,23</b>                  | ORANO 4 % 12.03.31                | 1.400.000                | EUR     | 1.519.712         | 0,17                         |
| <b>EL SALVADOR</b>             |                          |         |                  |                              | RCI BANQUE 2,625 % VRN            |                          |         |                   |                              |
| EL SALVADOR (GOVT)             |                          |         |                  |                              | 18.02.30                          | 2.500.000                | EUR     | 2.642.432         | 0,30                         |
| 8,25 % 10.04.32                | 2.199.000                | USD     | 1.835.265        | 0,21                         | TDF INFRASTRUCTURE                |                          |         |                   |                              |
| EL SALVADOR (GOVT)             |                          |         |                  |                              | 1,75 % 01.12.29                   | 2.500.000                | EUR     | 2.388.123         | 0,27                         |
| 8,625 % 28.02.29               | 350.000                  | USD     | 305.930          | 0,03                         | TDF INFRASTRUCTURE                |                          |         |                   |                              |
|                                |                          |         | <b>2.141.195</b> | <b>0,24</b>                  | 5,625 % 21.07.28                  | 2.000.000                | EUR     | 2.276.637         | 0,26                         |
| <b>FINNLAND</b>                |                          |         |                  |                              | TEREOS FINANCE GROUPE             |                          |         |                   |                              |
| HUHTAMAKI 5,125 %              |                          |         |                  |                              | 7,25 % 15.04.28                   | 1.500.000                | EUR     | 1.715.774         | 0,19                         |
| 24.11.28                       | 1.000.000                | EUR     | 1.120.527        | 0,13                         | TOTAL 1,625 % VRN PERP            | 4.000.000                | EUR     | 3.911.279         | 0,44                         |
| NORDEA BANK 4,875 % VRN        |                          |         |                  |                              | VEOLIA ENVIRONNEMENT              |                          |         |                   |                              |
| 23.02.34                       | 977.000                  | EUR     | 1.091.364        | 0,12                         | 2,25 % VRN PERP                   | 4.000.000                | EUR     | 4.123.218         | 0,47                         |
| SAMPO 2,5 % VRN 03.09.2052     | 3.450.000                | EUR     | 3.234.546        | 0,36                         |                                   |                          |         | <b>64.511.471</b> | <b>7,28</b>                  |
| TEOLLISUUDEN VOIMA             |                          |         |                  |                              | <b>GABUN</b>                      |                          |         |                   |                              |
| 4,75 % 01.06.30                | 2.500.000                | EUR     | 2.819.453        | 0,32                         | GABONESE (GOVT) 6,95 %            |                          |         |                   |                              |
|                                |                          |         | <b>8.265.890</b> | <b>0,93</b>                  | 16.06.25                          | 550.000                  | USD     | 540.645           | 0,06                         |
| <b>FRANKREICH</b>              |                          |         |                  |                              | <b>DEUTSCHLAND</b>                |                          |         |                   |                              |
| ACCOR 3,875 % 11.03.31         | 1.300.000                | EUR     | 1.417.205        | 0,16                         | ALLIANZ 2,625 % VRN PERP          | 4.000.000                | EUR     | 3.407.663         | 0,39                         |
| ALD 4 % 05.07.27               | 1.400.000                | EUR     | 1.525.895        | 0,17                         | COMMERZBANK 4 % VRN               |                          |         |                   |                              |
| ALD 4 % 24.01.31               | 2.000.000                | EUR     | 2.194.810        | 0,25                         | 05/12/2030                        | 2.500.000                | EUR     | 2.669.478         | 0,30                         |
| ARVAL SERVICE LEASE            |                          |         |                  |                              | DEUTSCHE BANK 3,035 %             |                          |         |                   |                              |
| FRANCE 4,75 % 22.05.27         | 2.000.000                | EUR     | 2.233.351        | 0,25                         | VRN 28.05.32                      | 880.000                  | USD     | 743.217           | 0,08                         |
| AUTOROUTES DU SUD DE LA        |                          |         |                  |                              | HELLA GMBH 0,5 %                  |                          |         |                   |                              |
| FRANCE 3,25 % 19.01.33         | 3.000.000                | EUR     | 3.230.954        | 0,36                         | 26.01.27                          | 2.000.000                | EUR     | 1.973.164         | 0,22                         |
| AXA 3,875 % VRN PERP           | 2.000.000                | EUR     | 2.145.905        | 0,24                         | MERCK 1,625 % VRN                 |                          |         |                   |                              |
| AXA 6,375 % VRN PERP           | 2.000.000                | EUR     | 2.245.910        | 0,25                         | 09/09/2080                        | 2.000.000                | EUR     | 2.036.050         | 0,23                         |
| BNP PARIBAS 1,125 % VRN        |                          |         |                  |                              | MUENCHENER RUECKVERSICHE-         |                          |         |                   |                              |
| 15.01.32                       | 2.000.000                | EUR     | 1.981.696        | 0,22                         | RUNG 3,25 % VRN 26.05.2049        | 3.000.000                | EUR     | 3.139.773         | 0,36                         |
| BPCE 2,125 % VRN 13.10.2046    | 2.600.000                | EUR     | 2.314.767        | 0,26                         | MUENCHENER RUECKVERSICHE-         |                          |         |                   |                              |
| BPCE 5,716 % VRN 18.01.30      | 1.750.000                | USD     | 1.761.358        | 0,20                         | RUNGSGE 1 % VRN 26.05.2042        | 1.000.000                | EUR     | 864.889           | 0,10                         |
| CREDIT AGRICOLE 5,5 %          |                          |         |                  |                              | SIXT 3,75 % 25.01.29              | 1.000.000                | EUR     | 1.090.707         | 0,12                         |
| VRN 28.08.33                   | 3.000.000                | EUR     | 3.409.712        | 0,39                         | VONOVIA 0,625 % 24.03.31          | 2.800.000                | EUR     | 2.414.275         | 0,27                         |
| CREDIT AGRICOLE 6,5 %          |                          |         |                  |                              |                                   |                          |         | <b>18.339.216</b> | <b>2,07</b>                  |
| VRN PERP                       | 2.000.000                | EUR     | 2.197.136        | 0,25                         | <b>GHANA</b>                      |                          |         |                   |                              |
| CREDIT AGRICOLE ASSURANCES     |                          |         |                  |                              | GHANA (GOVT) 7,625 %              |                          |         |                   |                              |
| 4,5 % VRN PERP                 | 1.600.000                | EUR     | 1.731.416        | 0,20                         | 16.05.29                          | 250.000                  | USD     | 129.432           | 0,01                         |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global High Income Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung                                  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|---|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|
| GHANA (GOVT) 7,75 %<br>07/04/2029                    | 700.000                  | USD     | 365.067           | 0,04                         | HUNGARY (GOVT) 5,5 %<br>16.06.34              | 1.861.000                | USD     | 1.832.918         | 0,21                         |
| GHANA (GOVT) 7,875 %<br>26.03.27                     | 1.307.000                | USD     | 678.832           | 0,09                         | HUNGARY (GOVT) 5,5 %<br>26.03.36              | 700.000                  | USD     | 681.239           | 0,08                         |
| GHANA (GOVT) 8,95 %<br>26.03.51                      | 250.000                  | USD     | 128.364           | 0,01                         | MAGYAR EXPORT IMPORT<br>BANK 6,125 % 04.12.27 | 300.000                  | USD     | 302.492           | 0,03                         |
|  |                          |         | <b>1.301.695</b>  | <b>0,15</b>                  | MVM ENERGETIKA 6,5 %<br>13.03.31              | 1.090.000                | USD     | 1.086.200         | 0,12                         |
| <b>GROSSBRITANNIEN</b>                               |                          |         |                   |                              |   |                          |         | <b>6.440.096</b>  | <b>0,73</b>                  |
| BARCLAYS 5,262 % VRN<br>29.01.34                     | 2.400.000                | EUR     | 2.803.106         | 0,32                         | <b>INDONESIEN</b>                             |                          |         |                   |                              |
| BARCLAYS 5,69 % VRN<br>12/03/2030                    | 615.000                  | USD     | 618.437           | 0,07                         | INDONESIA (GOVT) 2,15 %<br>28.07.31           | 2.530.000                | USD     | 2.095.908         | 0,23                         |
| BARCLAYS 6,692 % VRN<br>13.09.34                     | 790.000                  | USD     | 843.431           | 0,10                         | INDONESIA (GOVT) 4,15 %<br>29.03.27           | 600.000                  | USD     | 587.200           | 0,07                         |
| BARCLAYS 7,325 % VRN<br>02/11/2026                   | 2.130.000                | USD     | 2.182.847         | 0,25                         | INDONESIA (GOVT) 4,65 %<br>20.09.32           | 2.545.000                | USD     | 2.482.775         | 0,27                         |
| BARCLAYS 8 % VRN PERP<br>BP CAPITAL MARKETS          | 4.000.000                | USD     | 4.000.151         | 0,44                         | INDONESIA (GOVT) 4,7 %<br>06/06/2032          | 500.000                  | USD     | 491.454           | 0,06                         |
| BP CAPITAL MARKETS<br>3,25 % VRN PERP                | 2.000.000                | EUR     | 2.106.997         | 0,24                         | INDONESIA (GOVT) 4,85 %<br>11/01/2033         | 406.000                  | USD     | 403.071           | 0,05                         |
| BP CAPITAL MARKETS<br>4,375 % VRN PERP               | 207.000                  | USD     | 203.441           | 0,02                         | INDONESIA (GOVT) 5,45 %<br>20.09.52           | 425.000                  | USD     | 429.937           | 0,05                         |
| NGG FINANCE PLC 1,625 %<br>VRN 05.12.79              | 2.000.000                | EUR     | 2.121.476         | 0,24                         |   |                          |         | <b>6.490.345</b>  | <b>0,73</b>                  |
| ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP<br>3,073 % VRN 22.05.28 | 540.000                  | USD     | 504.549           | 0,06                         | <b>IRLAND</b>                                 |                          |         |                   |                              |
| ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP<br>3,754 % VRN 01.11.29 | 200.000                  | USD     | 196.896           | 0,02                         | AIB GROUP 2,875 % VRN<br>30.05.31             | 2.000.000                | EUR     | 2.087.084         | 0,24                         |
| STANDARD CHARTERED<br>1,822 % 23.11.25               | 2.025.000                | USD     | 1.970.302         | 0,22                         | AIB GROUP 5,25 % VRN<br>23.10.31              | 1.333.000                | EUR     | 1.556.019         | 0,18                         |
| STANDARD CHARTERED<br>6,097 % VRN 11.01.35           | 1.000.000                | USD     | 1.029.048         | 0,12                         | BANK OF IRELAND 6,75 %<br>VRN 01.03.33        | 3.000.000                | EUR     | 3.468.962         | 0,38                         |
| STANDARD CHARTERED<br>6,301 % VRN 09.01.29           | 800.000                  | USD     | 822.992           | 0,09                         |   |                          |         | <b>7.112.065</b>  | <b>0,80</b>                  |
| TRAFFORD CENTRE FINANCE<br>FRN 28.04.35              | 2.000.000                | GBP     | 797.083           | 0,09                         | <b>ISRAEL</b>                                 |                          |         |                   |                              |
| VODAFONE GROUP 2,625 %<br>VRN 27.08.80               | 3.000.000                | EUR     | 3.114.052         | 0,35                         | ISRAEL (GOVT) 3,375 %<br>15.01.50             | 1.750.000                | USD     | 1.180.343         | 0,13                         |
|  |                          |         | <b>23.314.808</b> | <b>2,63</b>                  | ISRAEL (GOVT) 5,75 %<br>12/03/2054            | 1.320.000                | USD     | 1.268.642         | 0,15                         |
| <b>GRIECHENLAND</b>                                  |                          |         |                   |                              |   |                          |         | <b>2.448.985</b>  | <b>0,28</b>                  |
| NATIONAL BANK OF GREECE<br>4,5 % VRN 29.01.29        | 1.731.000                | EUR     | 1.876.111         | 0,21                         | <b>ITALIEN</b>                                |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         | <b>1.876.111</b>  | <b>0,21</b>                  | ASSICURAZIONI GENERALI<br>5,272 % 12.09.33    | 1.601.000                | EUR     | 1.840.576         | 0,21                         |
| <b>HONGKONG</b>                                      |                          |         |                   |                              | ENEL 1,875 % VRN PERP                         | 1.800.000                | EUR     | 1.607.906         | 0,18                         |
| CNAC HK FINBRIDGE<br>3,375 % 19.06.24                | 850.000                  | USD     | 845.475           | 0,10                         | ENEL 4,75 % VRN PERP                          | 2.500.000                | EUR     | 2.684.634         | 0,30                         |
|  |                          |         | <b>845.475</b>    | <b>0,10</b>                  | INFRASTRUTTURE WIRELESS<br>1,625 % 21.10.28   | 1.333.000                | EUR     | 1.337.124         | 0,15                         |
| <b>UNGARN</b>  |                          |         |                   |                              | MUNDYS 4,75 % 24.01.29                        | 1.935.000                | EUR     | 2.131.118         | 0,24                         |
| HUNGARY (GOVT) 3,125 %<br>21.09.51                   | 250.000                  | USD     | 158.563           | 0,02                         | UNICREDIT 4 % 05.03.2034                      | 2.717.000                | EUR     | 2.977.311         | 0,33                         |
| HUNGARY (GOVT) 5,25 %<br>16.06.29                    | 2.400.000                | USD     | 2.378.684         | 0,27                         | UNICREDIT 4,8 % VRN<br>17.01.29               | 1.700.000                | EUR     | 1.914.968         | 0,22                         |
|  |                          |         |                   |                              | UNICREDIT 5,375 % VRN<br>16.04.34             | 1.500.000                | EUR     | 1.665.405         | 0,19                         |
|  |                          |         |                   |                              |   |                          |         | <b>16.159.042</b> | <b>1,82</b>                  |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global High Income Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapiieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|------------------|------------------------------|--|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|
| <b>Elfenbeinküste</b>   |                          |         |                  |                              | MEXICO (GOVT) 6,338 %<br>04/05/2053                            | 700.000                  | USD     | 693.393           | 0,08                         |
| AFRICAN DEVELOPMENT<br>BANK 5,75 % VRN PERP<br>IVORY COAST (GOVT)<br>6,125 % 15.06.33 | 650.000                  | USD     | 634.764          | 0,07                         | MEXICO (GOVT) 6,35 %<br>09/02/2035                             | 1.010.000                | USD     | 1.044.968         | 0,12                         |
| IVORY COAST (GOVT)<br>7,625 % 30.01.33  | 1.300.000                | USD     | 1.175.845        | 0,13                         | MEXICO (GOVT) 6,4 %<br>07/05/2054                              | 1.060.000                | USD     | 1.060.463         | 0,12                         |
| IVORY COAST (GOVT)<br>8,25 % 30.01.37   | 1.520.000                | USD     | 1.511.200        | 0,17                         | MEXICO CITY AIRPORT<br>TRUST 4,25 % 31.10.26                   | 800.000                  | USD     | 774.192           | 0,09                         |
|   | 1.745.000                | USD     | 1.753.488        | 0,20                         | MEXICO CITY AIRPORT<br>TRUST 5,5 % 31.07.47                    | 450.000                  | USD     | 380.314           | 0,04                         |
|   |                          |         | <b>5.075.297</b> | <b>0,57</b>                  | TRUST FIBRA 7,375 %<br>13.02.34                                | 950.000                  | USD     | 948.844           | 0,11                         |
| <b>KASACHSTAN</b>   |                          |         |                  |                              |  |                          |         | <b>9.827.580</b>  | <b>1,11</b>                  |
| KAZMUNAYGAS NATIONAL<br>4,75 % 19.04.27   | 750.000                  | USD     | 732.061          | 0,08                         | <b>NIEDERLANDE</b>   |                          |         |                   |                              |
| KAZMUNAYGAS NATIONAL<br>5,75 % 19.04.47   | 1.450.000                | USD     | 1.264.341        | 0,15                         | AERCAP HOLDINGS 5,875 %<br>VRN 10.10.79                        | 2.000.000                | USD     | 1.989.359         | 0,22                         |
|   |                          |         | <b>1.996.402</b> | <b>0,23</b>                  | ARGENTUM NETHERLANDS<br>2,75 % VRN 19.02.49                    | 2.000.000                | EUR     | 2.048.199         | 0,23                         |
| <b>LUXEMBURG</b>  |                          |         |                  |                              | ASR NEDERLAND 6,625 %<br>VRN PERP                              | 2.500.000                | EUR     | 2.704.280         | 0,31                         |
| ACU PETROLEO LUXEMBOURG<br>7,5 % 13.07.35   | 1.400.000                | USD     | 1.321.478        | 0,15                         | ASR NEDERLAND 7 % VRN<br>07/12/2043                            | 1.000.000                | EUR     | 1.249.190         | 0,14                         |
| ALBION FINANCING 6,125 %<br>15.10.26  | 1.250.000                | USD     | 1.239.166        | 0,14                         | BRASKEM NETHERLANDS<br>FINANCE 5,875 % 31.01.50                | 600.000                  | USD     | 463.416           | 0,05                         |
| COSAN LUXEMBOURG 7,5 %<br>27.06.30  | 900.000                  | USD     | 933.922          | 0,11                         | COOPERATIEVE RABOBANK<br>3,1 % VRN PERP                        | 2.600.000                | EUR     | 2.441.695         | 0,28                         |
| FS LUXEMBOURG 8,875 %<br>12/02/2031   | 380.000                  | USD     | 376.804          | 0,04                         | ING GROEP FRN 1 %<br>13.11.30                                  | 2.100.000                | EUR     | 2.153.478         | 0,24                         |
| GREENSAIF PIPELINES<br>BIDCO 6,129 % 23.02.38   | 507.000                  | USD     | 515.906          | 0,06                         | NATURGY FINANCE 2,374 %<br>VRN PERP                            | 3.000.000                | EUR     | 3.033.251         | 0,34                         |
| LOGICOR FINANCING<br>4,625 % 25.07.28   | 1.341.000                | EUR     | 1.466.503        | 0,17                         | NN GROUP 4,5 % VRN PERP<br>NN GROUP 4,625 % VRN<br>13.01.48    | 2.000.000                | EUR     | 2.183.531         | 0,25                         |
| MHP LUX 6,95 % 03.04.2026   | 350.000                  | USD     | 296.522          | 0,03                         | NN GROUP 6,375 % VRN PERP<br>PLUXEE 3,5 % 04.09.28             | 1.200.000                | EUR     | 1.303.789         | 0,15                         |
| RAIZEN FUELS FINANCE<br>6,95 % 05.03.54   | 300.000                  | USD     | 309.652          | 0,03                         | PROSUS 4,027 % 03.08.50<br>QPARK HOLDING 5,125 %<br>01/03/2029 | 1.800.000                | EUR     | 1.946.264         | 0,22                         |
|   |                          |         | <b>6.459.953</b> | <b>0,73</b>                  | TRIVIUM PACKAGING<br>FINANCE 5,5 % 15.08.2026                  | 2.580.000                | USD     | 1.657.369         | 0,19                         |
| <b>MAURITIUS</b>  |                          |         |                  |                              |  |                          |         | 546.468           | 0,06                         |
| GREENKO POWER 4,3 %<br>13.12.28   | 2.400.000                | USD     | 1.979.164        | 0,22                         |  |                          |         | 1.476.950         | 0,17                         |
| GREENKO SOLAR MAURITIUS<br>5,55 % 29.01.25  | 600.000                  | USD     | 593.663          | 0,07                         |  |                          |         | <b>27.364.078</b> | <b>3,09</b>                  |
|   |                          |         | <b>2.572.827</b> | <b>0,29</b>                  | <b>NIGERIA</b>   |                          |         |                   |                              |
| <b>MEXIKO</b>   |                          |         |                  |                              | NIGERIA (GOVT) 6,5 %<br>28.11.27                               | 1.615.000                | USD     | 1.523.103         | 0,17                         |
| BANCO MERCANTIL DEL<br>NORTE 6,625 % VRN PERP   | 500.000                  | USD     | 456.158          | 0,05                         | NIGERIA (GOVT) 7,143 %<br>23.02.30                             | 600.000                  | USD     | 546.812           | 0,06                         |
| BBVA BANCOMER 8,45 % VRN<br>29.06.38  | 800.000                  | USD     | 845.068          | 0,10                         | NIGERIA (GOVT) 7,625 %<br>28.11.47                             | 1.100.000                | USD     | 857.773           | 0,10                         |
| CEMEX 9,125 % VRN PERP<br>COMISION FEDERAL DE ELECT-<br>RICIDA 4,688 % 15.05.29       | 500.000                  | USD     | 542.955          | 0,06                         | NIGERIA (GOVT) 7,696 %<br>23.02.38                             | 600.000                  | USD     | 495.889           | 0,06                         |
| MEXICO (GOVT) 5,4 %<br>09/02/2028   | 1.280.000                | USD     | 1.205.076        | 0,14                         | NIGERIA (GOVT) 8,25 %<br>28.09.51                              | 500.000                  | USD     | 410.489           | 0,05                         |
| MEXICO (GOVT) 6,05 %<br>11/01/2040  | 1.468.000                | USD     | 1.478.872        | 0,16                         |  |                          |         |                   |                              |
|   | 400.000                  | USD     | 397.277          | 0,04                         |  |                          |         |                   |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global High Income Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung                                    | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|------------------|------------------------------|---|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|
| NIGERIA (GOVT) 8,375 %<br>24.03.29              | 400.000                  | USD     | 391.222          | 0,04                         | <b>SAUDI-ARABIEN</b>                                  |                          |         |                   |                              |
| NIGERIA (GOVT) 9,248 %<br>21.01.49              | 400.000                  | USD     | 367.265          | 0,04                         | GACI FIRST INVESTMENT<br>4,75 % 14.02.30              | 1.650.000                | USD     | 1.618.505         | 0,19                         |
|   |                          |         | <b>4.592.553</b> | <b>0,52</b>                  | GACI FIRST INVESTMENT<br>4,875 % 14.02.35             | 460.000                  | USD     | 439.849           | 0,05                         |
| <b>NORWEGEN</b>                                 |                          |         |                  |                              | GACI FIRST INVESTMENT<br>5,25 % 29.01.34              | 1.200.000                | USD     | 1.189.211         | 0,13                         |
| DNB BANK 5 % VRN<br>13.09.33                    | 2.400.000                | EUR     | 2.675.087        | 0,30                         | GACI FIRST INVESTMENT<br>5,375 % 29.01.54             | 1.000.000                | USD     | 891.507           | 0,10                         |
|   |                          |         | <b>2.675.087</b> | <b>0,30</b>                  | KSA SUKUK 4,27 %<br>22.05.29                          | 400.000                  | USD     | 390.893           | 0,04                         |
| <b>OMAN</b>                                     |                          |         |                  |                              | KSA SUKUK 4,511 %<br>22.05.33                         | 300.000                  | USD     | 293.587           | 0,03                         |
| LAMAR FUNDING 3,958 %<br>07/05/2025             | 400.000                  | USD     | 390.537          | 0,04                         | SAUDI ARABIA (GOVT) 3,25 %<br>17.11.51                | 1.250.000                | USD     | 844.163           | 0,10                         |
| OMAN (GOVT) 6 % 01.08.2029                      | 600.000                  | USD     | 614.686          | 0,07                         | SAUDI ARABIA (GOVT) 3,45 %<br>02/02/2061              | 650.000                  | USD     | 434.477           | 0,05                         |
|   |                          |         | <b>1.005.223</b> | <b>0,11</b>                  | SAUDI ARABIA (GOVT) 3,75 %<br>21.01.55                | 1.320.000                | USD     | 956.264           | 0,11                         |
| <b>PARAGUAY</b>                                 |                          |         |                  |                              | SAUDI ARABIA (GOVT) 4,5 %<br>17.04.30                 | 620.000                  | USD     | 608.495           | 0,07                         |
| PARAGUAY (GOVT) 5,85 %<br>21.08.33              | 2.750.000                | USD     | 2.760.127        | 0,31                         | SAUDI ARABIA (GOVT) 4,5 %<br>26.10.46                 | 2.012.000                | USD     | 1.723.343         | 0,20                         |
|   |                          |         | <b>2.760.127</b> | <b>0,31</b>                  | SAUDI ARABIA (GOVT) 4,75 %<br>16.01.30                | 1.550.000                | USD     | 1.534.886         | 0,17                         |
| <b>PERU</b>                                     |                          |         |                  |                              | SAUDI ARABIA (GOVT) 4,875 %<br>18.07.33               | 1.554.000                | USD     | 1.548.435         | 0,17                         |
| BANCO DE CREDITO DEL<br>PERU 5,85 % 11.01.29    | 1.100.000                | USD     | 1.113.073        | 0,13                         | SAUDI ARABIA (GOVT) 5 %<br>17.04.49                   | 1.385.000                | USD     | 1.263.542         | 0,14                         |
| BANCO INTERNACIONAL<br>7,625 % VRN 16.01.34     | 1.070.000                | USD     | 1.115.942        | 0,13                         | SAUDI ARABIA (GOVT) 5,5 %<br>25.10.32                 | 200.000                  | USD     | 207.537           | 0,02                         |
| PETROLEOS DEL PERU<br>4,75 % 19.06.32           | 580.000                  | USD     | 456.311          | 0,05                         | SAUDI ARABIA (GOVT) 5,75 %<br>16.01.54                | 1.910.000                | USD     | 1.893.924         | 0,22                         |
| PETROLEOS DEL PERU<br>5,625 % 19.06.47          | 2.344.000                | USD     | 1.567.613        | 0,17                         | SAUDI ELECTRICITY SUKUK<br>PROGRAM 5,194 % 13.02.2034 | 950.000                  | USD     | 954.631           | 0,11                         |
|   |                          |         | <b>4.252.939</b> | <b>0,48</b>                  | SUCI SECOND INVESTMENT<br>6 % 25.10.28                | 769.000                  | USD     | 796.088           | 0,09                         |
| <b>POLEN</b>                                    |                          |         |                  |                              |   |                          |         | <b>17.589.337</b> | <b>1,99</b>                  |
| BANK GOSPODARSTWA KRAJOWEGO<br>5,375 % 22.05.33 | 530.000                  | USD     | 528.644          | 0,06                         | <b>SÜDAFRIKA</b>                                      |                          |         |                   |                              |
| BANK GOSPODARSTWA KRAJOWEGO<br>6,25 % 31.10.28  | 300.000                  | USD     | 313.083          | 0,04                         | SOUTH AFRICA (GOVT)<br>5,75 % 30.09.49                | 200.000                  | USD     | 145.592           | 0,02                         |
| POLAND (GOVT) 5,125 %<br>18.09.34               | 310.000                  | USD     | 309.443          | 0,03                         |   |                          |         | <b>145.592</b>    | <b>0,02</b>                  |
| POLAND (GOVT) 5,5 %<br>16.11.27                 | 540.000                  | USD     | 552.492          | 0,06                         | <b>SÜDKOREA</b>                                       |                          |         |                   |                              |
|   |                          |         | <b>1.703.662</b> | <b>0,19</b>                  | SHINHAN FINANCIAL GROUP<br>5 % 24.07.28               | 950.000                  | USD     | 944.063           | 0,11                         |
| <b>PORTUGAL</b>                                 |                          |         |                  |                              |   |                          |         | <b>944.063</b>    | <b>0,11</b>                  |
| EDP ENERGIAS DE PORTUGAL<br>1,7 % VRN 20.07.80  | 2.300.000                | EUR     | 2.395.397        | 0,27                         | <b>SPANIEN</b>  |                          |         |                   |                              |
|   |                          |         | <b>2.395.397</b> | <b>0,27</b>                  | BANCO BILBAO VIZCAYA<br>ARGENTARIA 6 % VRN PERP       | 2.200.000                | EUR     | 2.376.117         | 0,27                         |
| <b>KATAR</b>                                    |                          |         |                  |                              | BANCO DE SABADELL 6 %<br>VRN 16.08.33                 | 2.000.000                | EUR     | 2.233.344         | 0,25                         |
| QATAR (GOVT) 4,4 %<br>16.04.50                  | 305.000                  | USD     | 270.275          | 0,03                         |   |                          |         |                   |                              |
| QATAR (GOVT) 5,103 %<br>23.04.48                | 210.000                  | USD     | 204.832          | 0,02                         |   |                          |         |                   |                              |
| QATAR PETROLEUM 3,3 %<br>12/07/2051             | 2.785.000                | USD     | 1.972.476        | 0,23                         |   |                          |         |                   |                              |
| QNB FINANCE 1,375 %<br>26.01.26                 | 750.000                  | USD     | 699.402          | 0,08                         |   |                          |         |                   |                              |
|   |                          |         | <b>3.146.985</b> | <b>0,36</b>                  |   |                          |         |                   |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global High Income Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl/ Nennwert | Währung | Kurswert          | % des Nettovermögens | Beschreibung  | Anzahl/ Nennwert | Währung | Kurswert         | % des Nettovermögens |
|---|------------------|---------|-------------------|----------------------|---|------------------|---------|------------------|----------------------|
| BANCO SANTANDER 1,625 %<br>22.10.30                   | 2.000.000        | EUR     | 1.867.244         | 0,21                 | TURKIYE VARLIK FONU<br>YONETIMI 8,25 % 14.02.2029   | 1.700.000        | USD     | 1.734.791        | 0,20                 |
| BANCO SANTANDER 5,538 %<br>VRN 14.03.30               | 1.000.000        | USD     | 1.000.467         | 0,11                 |   |                  |         | <b>8.118.997</b> | <b>0,92</b>          |
| BANCO SANTANDER 5,75 %<br>VRN 23.08.33                | 1.400.000        | EUR     | 1.590.240         | 0,18                 | <b>UKRAINE</b>                                      |                  |         |                  |                      |
| BANKINTER 1,25 % VRN<br>23.12.32                      | 2.000.000        | EUR     | 1.955.258         | 0,22                 | UKRAINE (GOVT) 0 % VRN<br>31.05.40                  | 170.000          | USD     | 94.768           | 0,01                 |
| CAIXABANK 1,25 % VRN<br>18.06.31                      | 2.800.000        | EUR     | 2.834.660         | 0,33                 | UKRAINE (GOVT) 7,75 %<br>01/09/2024                 | 250.000          | USD     | 94.435           | 0,01                 |
| IBERDROLA FINANZAS<br>4,871 % VRN PERP                | 900.000          | EUR     | 982.394           | 0,11                 | UKRAINE (GOVT) 7,75 %<br>01/09/2025                 | 501.000          | USD     | 188.476          | 0,02                 |
|   |                  |         | <b>14.839.724</b> | <b>1,68</b>          |   |                  |         | <b>377.679</b>   | <b>0,04</b>          |
| <b>SRI LANKA</b>                                      |                  |         |                   |                      | <b>VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE</b>                 |                  |         |                  |                      |
| SRI LANKA (GOVT) 6,85 %<br>14.03.2024****             | 1.141.000        | USD     | 630.403           | 0,07                 | ABU DHABI (GOVT) 3,125 %<br>16.04.30                | 250.000          | USD     | 230.535          | 0,03                 |
|   |                  |         | <b>630.403</b>    | <b>0,07</b>          | ABU DHABI (GOVT) 4,125 %<br>11/10/2047              | 2.097.000        | USD     | 1.773.630        | 0,20                 |
| <b>SCHWEDEN</b>                                       |                  |         |                   |                      | TAQA ABU DHABI NATIONAL<br>ENERGY 6,5 % 27.10.36    | 350.000          | USD     | 396.878          | 0,04                 |
| EPIROC 3,625 % 28.02.31                               | 2.000.000        | EUR     | 2.169.884         | 0,25                 |   |                  |         | <b>2.401.043</b> | <b>0,27</b>          |
| SKANDINAVISKA ENSKILDA<br>BANKE 0,75 % VRN 03.11.2031 | 3.000.000        | EUR     | 2.969.810         | 0,34                 | <b>USA</b>  |                  |         |                  |                      |
| SKANDINAVISKA ENSKILDA<br>BANKEN 3,875 % 09.05.28     | 3.500.000        | EUR     | 3.847.448         | 0,42                 | AIR LEASE 4,65 % VRN PERP<br>ALEXANDRIA REAL ESTATE | 1.500.000        | USD     | 1.419.652        | 0,16                 |
| TELIA 2,75 % VRN<br>30.06.83                          | 2.000.000        | EUR     | 2.024.217         | 0,23                 | EQUITIES 5,15 % 15.04.2053                          | 320.000          | USD     | 295.020          | 0,03                 |
|   |                  |         | <b>11.011.359</b> | <b>1,24</b>          | AMGEN 5,15 % 02.03.28                               | 1.000.000        | USD     | 1.007.583        | 0,11                 |
| <b>SCHWEIZ</b>  |                  |         |                   |                      | ARSENAL AIC PARENT<br>8 % 01.10.30                  | 1.068.000        | USD     | 1.126.460        | 0,13                 |
| CREDIT SUISSE 3,625 %<br>09/09/2024                   | 5.000.000        | USD     | 4.954.483         | 0,56                 | ASHTREAD CAPITAL 5,95 %<br>15.10.33                 | 3.620.000        | USD     | 3.664.804        | 0,41                 |
|   |                  |         | <b>4.954.483</b>  | <b>0,56</b>          | ATT 3,5 % 01.06.41                                  | 1.000.000        | USD     | 782.247          | 0,09                 |
| <b>THAILAND</b>                                       |                  |         |                   |                      | ATT 4,3 % 18.11.34                                  | 1.800.000        | EUR     | 2.055.689        | 0,23                 |
| BANGKOK BANK 5 % VRN<br>PERP                          | 1.000.000        | USD     | 974.217           | 0,11                 | BALL CORP 6,875 %<br>15.03.28                       | 1.500.000        | USD     | 1.542.830        | 0,17                 |
|   |                  |         | <b>974.217</b>    | <b>0,11</b>          | BIMBO BAKERIES 6,4 %<br>15.01.34                    | 1.050.000        | USD     | 1.128.431        | 0,13                 |
| <b>TRINIDAD &amp; TOBAGO</b>                          |                  |         |                   |                      | CSX 5,2 % 15.11.33                                  | 2.000.000        | USD     | 2.038.052        | 0,23                 |
| TRINIDAD TOBAGO (GOVT)<br>4,5 % 26.06.30              | 200.000          | USD     | 187.861           | 0,02                 | DAE FUNDING 1,55 %<br>01/08/2024                    | 610.000          | USD     | 601.174          | 0,07                 |
| TRINIDAD & TOBAGO<br>(GOVT) 5,95 % 14.01.2031         | 4.330.000        | USD     | 4.351.905         | 0,49                 | DUKE ENERGY 4,85 %<br>05/01/2029                    | 1.950.000        | USD     | 1.933.443        | 0,22                 |
|   |                  |         | <b>4.539.766</b>  | <b>0,51</b>          | ENERGY TRANSFER 5,55 %<br>15.05.34                  | 580.000          | USD     | 582.647          | 0,07                 |
| <b>TÜRKEI</b>   |                  |         |                   |                      | FISERV 5,45 % 15.03.34                              | 1.000.000        | USD     | 1.014.381        | 0,11                 |
| AKBANK 9,3686 % VRN PERP                              | 3.000.000        | USD     | 2.988.747         | 0,33                 | FORD MOTOR CREDIT<br>6,125 % 15.05.28               | 1.500.000        | EUR     | 1.748.924        | 0,20                 |
| TURKEY (GOVT) 5,75 %<br>11/05/2047                    | 1.150.000        | USD     | 876.481           | 0,10                 | FORD MOTOR CREDIT<br>7,122 % 07.11.33               | 2.500.000        | USD     | 2.695.313        | 0,30                 |
| TURKEY (GOVT) 6,5 %<br>20.09.33                       | 720.000          | USD     | 676.929           | 0,08                 | FORD MOTOR CREDIT 7,35 %<br>06/03/2030              | 1.000.000        | USD     | 1.067.510        | 0,12                 |
| TURKEY (GOVT) 7,625 %<br>15.05.34                     | 370.000          | USD     | 372.002           | 0,04                 | GENERAL MOTORS<br>FINANCIAL 5,75 % 08.02.31         | 205.000          | USD     | 207.401          | 0,02                 |
| TURKEY (GOVT) 9,125 %<br>13.07.30                     | 300.000          | USD     | 325.530           | 0,04                 | GENERAL MOTORS<br>FINANCIAL 5,8 % 07.01.29          | 600.000          | USD     | 611.373          | 0,07                 |
| TURKEY (GOVT) 9,375 %<br>14.03.29                     | 1.050.000        | USD     | 1.144.517         | 0,13                 |   |                  |         |                  |                      |

\*\*\*\* Der Vermögenswert, der am 14. März 2024 fällig war, ist notleidend. Zur Bewertung wurde der letzte verfügbare Preis auf dem Markt herangezogen.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global High Income Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung                                   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|---|--------------------------|---------|--------------------|------------------------------|
| GLOBAL PAYMENTS 4,875 %<br>17.03.31            | 4.000.000                | EUR     | 4.562.959         | 0,52                         | <b>URUGUAY</b>  |                          |         |                    |                              |
| HCA 6 % 01.04.54                               | 1.110.000                | USD     | 1.130.350         | 0,13                         | URUGUAY (GOVT) 5,75 %<br>28.10.34                                   | 2.940.000                | USD     | 3.107.579          | 0,35                         |
| JPMORGAN CHASE 3,761 %<br>VRN 21.03.34         | 1.563.000                | EUR     | 1.711.968         | 0,19                         |   |                          |         | <b>3.107.579</b>   | <b>0,35</b>                  |
| JPMORGAN CHASE 4,6 % VRN<br>PERP               | 2.170.000                | USD     | 2.140.889         | 0,24                         | <b>SUMME ANLEIHEN</b>   |                          |         | <b>424.920.536</b> | <b>47,98</b>                 |
| MICRON TECHNOLOGY 5,3 %<br>15.01.31            | 250.000                  | USD     | 251.895           | 0,03                         | <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>                             |                          |         |                    |                              |
| MOTOROLA SOLUTIONS 5,4 %<br>15.04.34           | 610.000                  | USD     | 609.519           | 0,07                         | <b>AUSTRALIEN</b>   |                          |         |                    |                              |
| NORTHERN TRUST 6,125 %<br>02/11/2032           | 2.000.000                | USD     | 2.116.251         | 0,24                         | LA TROBE FINANCIAL CAPITAL<br>MARKET FRN 14.11.2053                 | 1.810.000                | AUD     | 528.823            | 0,06                         |
| OCCIDENTAL PETROLEUM<br>8,5 % 15.07.27         | 1.000.000                | USD     | 1.084.836         | 0,12                         |   |                          |         | <b>528.823</b>     | <b>0,06</b>                  |
| SASOL FINANCING 4,375 %<br>18.09.26            | 200.000                  | USD     | 188.633           | 0,02                         | <b>GROSSBRITANNIEN</b>  |                          |         |                    |                              |
| SASOL FINANCING 8,75 %<br>03/05/2029           | 820.000                  | USD     | 835.239           | 0,09                         | MITCHELLS & BUTLERS<br>1,40313 % 15.09.34                           | 579.000                  | GBP     | 631.686            | 0,07                         |
| SOUTHWESTERN ENERGY<br>5,375 % 15.03.30        | 1.600.000                | USD     | 1.542.976         | 0,17                         | POLARIS FRN 26.02.61<br>(XS2765489211)                              | 900.000                  | GBP     | 1.138.715          | 0,13                         |
| SPRINT CAPITAL 6,875 %<br>15.11.28             | 3.000.000                | USD     | 3.193.441         | 0,36                         | PRECISE MORTGAGE FUNDING<br>FRN 10.16.2056                          | 500.000                  | GBP     | 632.479            | 0,07                         |
| SUNOCO LOGISTICS<br>PARTNERS 5,35 % 15.05.45   | 1.800.000                | USD     | 1.666.314         | 0,19                         |   |                          |         | <b>2.402.880</b>   | <b>0,27</b>                  |
| TAPESTRY 7,7 % 27.11.2030                      | 1.000.000                | USD     | 1.070.091         | 0,12                         | <b>IRLAND</b>   |                          |         |                    |                              |
| TARGA RESOURCES<br>PARTNERS 6,15 % 01.03.29    | 950.000                  | USD     | 990.759           | 0,11                         | CVC CORDATUS LOAN FUND<br>FRN 17.06.32                              | 2.000.000                | EUR     | 2.178.447          | 0,25                         |
| TENET HEALTHCARE 4,25 %<br>01/06/2029          | 500.000                  | USD     | 464.314           | 0,05                         | DRYDEN CLO FRN 15.04.2035   | 1.000.000                | EUR     | 1.067.725          | 0,12                         |
| TMOBILE 5,05 % 15.07.2033                      | 1.440.000                | USD     | 1.426.403         | 0,16                         | HARVEST CLO FRN<br>20.10.2032 (XS2112471185)                        | 2.000.000                | EUR     | 2.122.626          | 0,24                         |
| TMOBILE 5,5 % 15.01.55                         | 200.000                  | USD     | 200.199           | 0,02                         | RIVER GREEN FINANCE FRN<br>22.01.32                                 | 1.225.000                | EUR     | 884.385            | 0,10                         |
| UNITED RENTALS NORTH<br>AMERICA 6 % 15.12.2029 | 2.000.000                | USD     | 2.017.367         | 0,23                         |   |                          |         | <b>6.253.183</b>   | <b>0,71</b>                  |
| US (GOVT) 3,375 % 15.11.48                     | 169.000                  | USD     | 141.683           | 0,02                         | <b>ITALIEN</b>  |                          |         |                    |                              |
| US (GOVT) 3,875 % 15.02.43                     | 310.000                  | USD     | 287.501           | 0,03                         | ERNA FRN 25.07.2031   | 1.000.000                | EUR     | 495.118            | 0,06                         |
| US (GOVT) 4 % 15.01.2027                       | 3.100.000                | USD     | 3.065.125         | 0,35                         |   |                          |         | <b>495.118</b>     | <b>0,06</b>                  |
| US (GOVT) 4,125 % 31.01.25                     | 700.000                  | USD     | 694.408           | 0,08                         | <b>NIEDERLANDE</b>  |                          |         |                    |                              |
| US (GOVT) 4,125 % 15.08.53                     | 450.000                  | USD     | 433.969           | 0,05                         | DELPHINUS FRN 22.03.2102  | 1.000.000                | EUR     | 1.065.669          | 0,12                         |
| US (GOVT) 4,25 % 31.12.24                      | 1.000.000                | USD     | 993.242           | 0,11                         |   |                          |         | <b>1.065.669</b>   | <b>0,12</b>                  |
| US (GOVT) 4,25 % 31.12.25                      | 4.700.000                | USD     | 4.663.740         | 0,54                         | <b>USA</b>  |                          |         |                    |                              |
| US (GOVT) 4,5 % 15.11.33                       | 3.121.000                | USD     | 3.195.368         | 0,36                         | APIDOS CLO FRN 21.04.2035   | 1.000.000                | USD     | 1.001.905          | 0,11                         |
| US (GOVT) 4,5 % 15.02.44                       | 160.000                  | USD     | 161.363           | 0,02                         | COMMERCIAL MORTGAGE<br>TRUST VRN 10.07.2046                         | 2.000.000                | USD     | 1.415.123          | 0,16                         |
| US (GOVT) 4,625 % 30.06.25                     | 2.000.000                | USD     | 1.993.477         | 0,23                         |   |                          |         | <b>2.417.028</b>   | <b>0,27</b>                  |
| US (GOVT) 4,75 % 15.11.2053                    | 3.760.000                | USD     | 4.026.138         | 0,45                         | <b>SUMME FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>                       |                          |         | <b>13.162.701</b>  | <b>1,49</b>                  |
| WALGREENS BOOTS<br>ALLIANCE 3,45 % 01.06.2026  | 1.000.000                | USD     | 955.160           | 0,11                         | <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN<br/>BÖRSE NOTIERTEN WERTPAPIERE</b> |                          |         | <b>438.083.237</b> | <b>49,47</b>                 |
|  |                          |         | <b>73.338.511</b> | <b>8,28</b>                  | <b>WERTPAPIERE</b>  |                          |         |                    |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global High Income Bond (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--------------------------|---------|------------------|------------------------------|--|--------------------------|---------|------------------|------------------------------|
| <b>AN EINEM ANDEREM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE, ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |                          |         |                  |                              | OPEN TEXT 6,9 % 01.12.2027                                     |                          |         |                  |                              |
| <b>ANLEIHEN</b>  |                          |         |                  |                              | <b>CHILE</b>   |                          |         |                  |                              |
| <b>ARGENTINIEN</b>   |                          |         |                  |                              | CHILE (GOVT) 4,34 %  |                          |         |                  |                              |
| ARGENTINA (GOVT) 0,125 %<br>09/07/2030                                       | 2.788.815                | USD     | 1.450.345        | 0,16                         | 07/03/2042   | 350.000                  | USD     | 306.243          | 0,03                         |
| ARGENTINA (GOVT) 0,125 %<br>09/01/2038                                       | 2.234.000                | USD     | 1.040.642        | 0,12                         | CODELCO 3,625 % 01.08.2027                                     | 1.000.000                | USD     | 945.279          | 0,11                         |
| ARGENTINA (GOVT) 0,125 %<br>09/07/2041                                       | 3.106.236                | USD     | 1.260.198        | 0,14                         | CORP NACIONAL DEL COBRE<br>DE CHILE 3,15 % 15.01.2051          | 300.000                  | USD     | 187.691          | 0,02                         |
| ARGENTINA (GOVT) 1 %<br>09/07/2029   | 467.444                  | USD     | 249.592          | 0,03                         | CORP NACIONAL DEL COBRE<br>DE CHILE 4,5 % 01.08.47             | 200.000                  | USD     | 158.130          | 0,02                         |
|  |                          |         | <b>4.000.777</b> | <b>0,45</b>                  | EMPRESA NACIONAL DEL<br>PETROLEO 3,45 % 16.09.31               | 750.000                  | USD     | 641.052          | 0,07                         |
| <b>AUSTRALIEN</b>  |                          |         |                  |                              | EMPRESA NACIONAL DEL<br>PETROLEO 3,75 % 05.08.2026             |                          |         |                  |                              |
| FMG RESOURCES 4,375 %<br>01/04/2031  | 500.000                  | USD     | 447.209          | 0,05                         | 704.000  | USD                      | 673.210 | 0,08             |                              |
| FMG RESOURCES 6,125 %<br>15.04.32  | 1.000.000                | USD     | 990.228          | 0,11                         | EMPRESA NACIONAL DEL<br>PETROLEO 5,25 % 06.11.29               | 1.050.000                | USD     | 1.028.090        | 0,12                         |
| MINERAL RESOURCES 8 %<br>01/11/2027  | 2.000.000                | USD     | 2.041.594        | 0,23                         | INVERSIONES CMPC 6,125 %<br>26.02.34                           | 712.000                  | USD     | 724.080          | 0,08                         |
|  |                          |         | <b>3.479.031</b> | <b>0,39</b>                  |  |                          |         | <b>4.663.775</b> | <b>0,53</b>                  |
| <b>BRASILIEN</b>   |                          |         |                  |                              | <b>CHINA</b>   |                          |         |                  |                              |
| BANCO BTG PACTUAL<br>SACAYMAN ISLAND 4,5 %<br>10/01/2025                     | 950.000                  | USD     | 938.142          | 0,11                         | ALIBABA GROUP 3,15 %<br>09/02/2051                             | 800.000                  | USD     | 534.600          | 0,06                         |
| BANCO DO BRASIL 6 %<br>18.03.31  | 840.000                  | USD     | 842.012          | 0,10                         | ALIBABA GROUP HOLDING<br>2,125 % 09.02.31                      | 1.250.000                | USD     | 1.040.305        | 0,11                         |
| BANCO DO BRASIL 6,25 %<br>VRN PERP   | 800.000                  | USD     | 804.981          | 0,09                         | TENCENT HOLDINGS 2,39 %<br>03/06/2030                          | 1.000.000                | USD     | 855.178          | 0,10                         |
| BRAZIL (GOVT) 6,25 %<br>18.03.31   | 1.200.000                | USD     | 1.225.477        | 0,14                         | TENCENT HOLDINGS 3,24 %<br>03/06/2050                          | 600.000                  | USD     | 408.088          | 0,05                         |
| MC BRAZIL DOWNSTREAM<br>TRADING 7,25 % 30.06.2031                            | 1.700.000                | USD     | 1.469.521        | 0,16                         | TENCENT HOLDINGS 3,975 %<br>11/04/2029                         | 200.000                  | USD     | 190.227          | 0,02                         |
|  |                          |         | <b>5.280.133</b> | <b>0,60</b>                  | TENCENT HOLDINGS 4,525 %<br>11/04/2049                         | 200.000                  | USD     | 172.706          | 0,02                         |
| <b>KANADA</b>  |                          |         |                  |                              | <b>KOLUMBIEN</b>   |                          |         |                  |                              |
| ALIMENTATION COUCHE<br>5,267 % 12.02.34                                      | 500.000                  | USD     | 499.829          | 0,06                         | BANCO GNB SUDAMERIS<br>7,5 % VRN 16.04.31                      | 1.400.000                | USD     | 1.201.335        | 0,13                         |
| CASCADES INC CASCADES<br>5,125 % 15.01.26                                    | 1.500.000                | USD     | 1.478.558        | 0,17                         | COLOMBIA (GOVT) 4,125 %<br>15.05.51                            | 500.000                  | USD     | 312.701          | 0,04                         |
| FIRST QUANTUM MINERALS<br>6,875 % 15.10.27                                   | 1.000.000                | USD     | 959.807          | 0,11                         | ECOPETROL 5,375 %<br>26.06.26                                  | 380.000                  | USD     | 374.051          | 0,04                         |
| FIRST QUANTUM MINERALS<br>9,375 % 01.03.29                                   | 3.200.000                | USD     | 3.318.665        | 0,37                         |  |                          |         | <b>1.888.087</b> | <b>0,21</b>                  |
| FIRST QUANTUM MINERALS 9,375 %<br>01.03.2029 (USC3535CAQ18)                  | 480.000                  | USD     | 497.800          | 0,06                         | <b>COSTA RICA</b>  |                          |         |                  |                              |
| GFL ENVIRONMENTAL 6,75 %<br>15.01.31   | 507.000                  | USD     | 520.627          | 0,06                         | COSTA RICA (GOVT)<br>6,125 % 19.02.31                          | 2.227.000                | USD     | 2.258.741        | 0,26                         |
| KINROSS GOLD 6,25 %<br>15.07.33  | 1.500.000                | USD     | 1.559.520        | 0,18                         | COSTA RICA (GOVT) 7,3 %<br>13.11.54                            | 300.000                  | USD     | 319.305          | 0,04                         |
| NOVA CHEMICALS 9 %<br>15.02.30   | 2.000.000                | USD     | 2.067.720        | 0,23                         | INSTITUTO COSTARRICENSE DE ELE-<br>CTRICIDAD 6,75 % 07.10.2031 | 300.000                  | USD     | 303.216          | 0,03                         |
|  |                          |         |                  |                              |  |                          |         | <b>2.881.262</b> | <b>0,33</b>                  |
|  |                          |         |                  |                              | <b>DOMINIKANISCHE REPUBLIK</b>                                 |                          |         |                  |                              |
|  |                          |         |                  |                              | DOMINIC (GOVT) 5,5 %<br>22.02.29                               | 1.860.000                | USD     | 1.809.185        | 0,20                         |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global High Income Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapiere zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|------------------|------------------------------|--|--------------------------|---------|------------------|------------------------------|
| DOMINIC (GOVT) 5,875 %<br>30.01.60                    | 875.000                  | USD     | 745.734          | 0,08                         | <b>GUATEMALA</b>                                     |                          |         |                  |                              |
| DOMINIC (GOVT) 5,95 %<br>25.01.27                     | 340.000                  | USD     | 339.291          | 0,04                         | CT TRUST 5,125 %<br>03/02/2032                       | 1.000.000                | USD     | 886.651          | 0,10                         |
| DOMINIC (GOVT) 6 %<br>22.02.33                        | 600.000                  | USD     | 584.330          | 0,07                         |  |                          |         | <b>886.651</b>   | <b>0,10</b>                  |
|   |                          |         | <b>3.478.540</b> | <b>0,39</b>                  | <b>HONGKONG</b>                                      |                          |         |                  |                              |
| <b>ECUADOR</b>  |                          |         |                  |                              | SHIMAO PROPERTY HOLDINGS<br>4,75 % 03.07.2022*****   | 1.100.000                | USD     | 41.105           | 0,00                         |
| ECUADOR (GOVT) 0,5 %<br>31.07.30                      | 600.000                  | USD     | 408.286          | 0,05                         |  |                          |         | <b>41.105</b>    | <b>0,00</b>                  |
| ECUADOR (GOVT) 0,5 %<br>31.07.35                      | 2.020.000                | USD     | 1.066.068        | 0,12                         | <b>INDIEN</b>  |                          |         |                  |                              |
|   |                          |         | <b>1.474.354</b> | <b>0,17</b>                  | SHRIRAM FINANCE 6,625 %<br>22.04.27                  | 1.000.000                | USD     | 1.004.534        | 0,11                         |
| <b>ÄGYPTEN</b>  |                          |         |                  |                              |  |                          |         | <b>1.004.534</b> | <b>0,11</b>                  |
| EGYPT (GOVT) 7,5 %<br>31.01.27                        | 1.220.000                | USD     | 1.177.571        | 0,13                         | <b>INDONESIEN</b>                                    |                          |         |                  |                              |
|   |                          |         | <b>1.177.571</b> | <b>0,13</b>                  | FREEPORT INDONESIA<br>5,315 % 14.04.32               | 340.000                  | USD     | 332.823          | 0,04                         |
| <b>EL SALVADOR</b>                                    |                          |         |                  |                              | FREEPORT INDONESIA 6,2 %<br>14.04.52                 | 400.000                  | USD     | 398.524          | 0,05                         |
| EL SALVADOR (GOVT)<br>6,375 % 18.01.27                | 800.000                  | USD     | 698.473          | 0,08                         | INDONESIA (GOVT) 4,75 %<br>11/02/2029                | 616.000                  | USD     | 612.955          | 0,06                         |
|   |                          |         | <b>698.473</b>   | <b>0,08</b>                  |  |                          |         | <b>1.344.302</b> | <b>0,15</b>                  |
| <b>FRANKREICH</b>                                     |                          |         |                  |                              | <b>IRLAND</b>  |                          |         |                  |                              |
| BNP PARIBAS CARDIF<br>4,032 % VRN PERP                | 2.000.000                | EUR     | 2.142.667        | 0,24                         | AERCAP IRELAND CAPITAL<br>DAC AERC 3,85 % 29.10.2041 | 1.950.000                | USD     | 1.542.089        | 0,17                         |
| GROUPE DES ASSURANCES<br>DU CRE 1,85 % VRN 21.04.2042 | 2.500.000                | EUR     | 2.225.381        | 0,26                         | AIB GROUP 6,608 % VRN<br>13.09.29                    | 550.000                  | USD     | 573.783          | 0,06                         |
| SOCIETE GENERALE 5,634 %<br>VRN 19.01.30              | 1.250.000                | USD     | 1.246.249        | 0,14                         | ARDAGH PACKAGING<br>FINANCE 2,125 % 15.08.2026       | 2.000.000                | EUR     | 1.867.987        | 0,21                         |
| SOCIETE GENERALE 6,691 %<br>VRN 10.01.34              | 435.000                  | USD     | 456.936          | 0,05                         | ARDAGH PACKAGING<br>FINANCE 5,25 % 15.08.27          | 1.500.000                | USD     | 949.475          | 0,11                         |
|   |                          |         | <b>6.071.233</b> | <b>0,69</b>                  | AVOLON HOLDINGS FUNDING<br>3,95 % 01.07.24           | 1.545.000                | USD     | 1.536.460        | 0,17                         |
| <b>DEUTSCHLAND</b>                                    |                          |         |                  |                              | ROADSTER FINANCE DESIGNATED<br>2,375 % 08.12.32      | 2.050.000                | EUR     | 2.024.768        | 0,24                         |
| DEUTSCHE BANK 1,625 %<br>20.01.27                     | 2.000.000                | EUR     | 2.037.522        | 0,23                         | SMURFIT KAPPA TREASURY<br>5,777 % 03.04.54           | 520.000                  | USD     | 520.000          | 0,06                         |
| DEUTSCHE BANK 2,311 %<br>VRN 16.11.27                 | 2.450.000                | USD     | 2.240.774        | 0,25                         |  |                          |         | <b>9.014.562</b> | <b>1,02</b>                  |
| DEUTSCHE BANK 4,5 % VRN<br>PERP                       | 2.000.000                | EUR     | 1.866.302        | 0,21                         | <b>ITALIEN</b>                                       |                          |         |                  |                              |
|   |                          |         | <b>6.144.598</b> | <b>0,69</b>                  | AUTOSTRADA PER LITALIA<br>2 % 04.12.28               | 2.000.000                | EUR     | 2.003.113        | 0,23                         |
| <b>GROSSBRITANNIEN</b>                                |                          |         |                  |                              | INTESA SANPAOLO 3,875 %<br>14.07.27                  | 5.000.000                | USD     | 4.704.270        | 0,53                         |
| MACQUARIE AIRFINANCE<br>HOLDINGS 6,4 % 26.03.29       | 80.000                   | USD     | 81.308           | 0,01                         | INTESA SANPAOLO 4,198 %<br>01/06/2032                | 430.000                  | USD     | 360.438          | 0,04                         |
| MACQUARIE AIRFINANCE<br>HOLDINGS 6,5 % 26.03.31       | 1.076.000                | USD     | 1.096.622        | 0,12                         |  |                          |         | <b>7.067.821</b> | <b>0,80</b>                  |
| MACQUARIE AIRFINANCE<br>HOLDINGS 8,125 % 30.03.29     | 2.000.000                | USD     | 2.116.746        | 0,23                         | <b>JERSEY</b>  |                          |         |                  |                              |
| STANDARD CHARTERED<br>7,875 % VRN PERP                | 2.000.000                | USD     | 1.997.220        | 0,23                         | ADIANT GLOBAL HOLDINGS<br>7 % 15.04.28               | 1.547.000                | USD     | 1.583.635        | 0,18                         |
| VODAFONE GROUP 3,25 %<br>VRN 04.06.81                 | 435.000                  | USD     | 407.620          | 0,05                         | GALAXY PIPELINE ASSETS<br>2,625 % 31.03.36           | 4.200.000                | USD     | 3.429.013        | 0,39                         |
|   |                          |         | <b>5.699.516</b> | <b>0,64</b>                  |  |                          |         | <b>5.012.648</b> | <b>0,57</b>                  |

\*\*\*\*\* Der Vermögenswert, der am 3. Juli 2022 fällig war, ist notleidend. Der Ausschuss für die Preisbestimmung die und Verwaltungsgesellschaft haben vereinbart, den letzten am Markt verfügbaren Preis zu verwenden.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global High Income Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung                | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung                        | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|-----------------------------|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|-------------------------------------|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|
| <b>LIBERIA</b>              |                          |         |                   |                              | <b>PHOENIX PIB DUTCH</b>            |                          |         |                   |                              |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES     |                          |         |                   |                              | FINANCE 2,375 % 05.08.25            | 2.000.000                | EUR     | 2.105.610         | 0,24                         |
| 8,25 % 15.01.29             | 1.500.000                | USD     | 1.589.586         | 0,18                         | PROSUS 3,257 % 19.01.27             | 400.000                  | USD     | 371.183           | 0,04                         |
|                             |                          |         | <b>1.589.586</b>  | <b>0,18</b>                  | PROSUS 4,987 % 19.01.52             | 300.000                  | USD     | 221.424           | 0,03                         |
| <b>LUXEMBURG</b>            |                          |         |                   |                              | <b>TRIVIUM PACKAGING</b>            |                          |         |                   |                              |
| AEGEA FINANCE 6,75 %        |                          |         |                   |                              | FINANCE 8,5 % 15.08.27              | 500.000                  | USD     | 494.506           | 0,06                         |
| 20.05.29                    | 1.850.000                | USD     | 1.810.116         | 0,21                         | VZ SECURED FINANCING 5 %            |                          |         |                   |                              |
| CHILE ELECTRICITY 6,01 %    |                          |         |                   |                              | 15.01.32                            | 1.500.000                | USD     | 1.289.072         | 0,15                         |
| 20.01.33                    | 650.000                  | USD     | 659.655           | 0,07                         |                                     |                          |         | <b>12.313.306</b> | <b>1,39</b>                  |
| MILLICOM INTERNATIONAL      |                          |         |                   |                              | <b>NIGERIA</b>                      |                          |         |                   |                              |
| CELLULAR 7,375 % 02.04.2032 | 1.189.000                | USD     | 1.190.500         | 0,13                         | <b>NIGERIA (GOVT) 7,875 %</b>       |                          |         |                   |                              |
| RAIZEN FUELS FINANCE        |                          |         |                   |                              | <b>16.02.32</b>                     |                          |         |                   |                              |
| 6,45 % 05.03.34             | 400.000                  | USD     | 410.717           | 0,05                         |                                     | 900.000                  | USD     | 817.262           | 0,09                         |
|                             |                          |         | <b>4.070.988</b>  | <b>0,46</b>                  |                                     |                          |         | <b>817.262</b>    | <b>0,09</b>                  |
| <b>MACAU</b>                |                          |         |                   |                              | <b>PARAGUAY</b>                     |                          |         |                   |                              |
| SANDS CHINA 5,4 %           |                          |         |                   |                              | <b>BANCO CONTINENTAL 2,75 %</b>     |                          |         |                   |                              |
| 08/08/2028                  | 800.000                  | USD     | 785.101           | 0,09                         | <b>10/12/2025</b>                   |                          |         |                   |                              |
|                             |                          |         | <b>785.101</b>    | <b>0,09</b>                  |                                     | 658.000                  | USD     | 621.058           | 0,07                         |
| <b>MEXIKO</b>               |                          |         |                   |                              | <b>PARAGUAY (GOVT) 3,849 %</b>      |                          |         |                   |                              |
| BANCO MERCANTIL DEL NORTE   |                          |         |                   |                              | <b>28.06.33</b>                     |                          |         |                   |                              |
| SAGRAN 5,875 % VRN PERP     | 840.000                  | USD     | 803.992           | 0,09                         |                                     | 500.000                  | USD     | 437.989           | 0,05                         |
| BANCO SANTANDER MEXICO      |                          |         |                   |                              | <b>PARAGUAY (GOVT) 5,4 %</b>        |                          |         |                   |                              |
| 5,375 % 17.04.25            | 500.000                  | USD     | 498.183           | 0,06                         | <b>30.03.50</b>                     |                          |         |                   |                              |
| BBVA BANCO 5,125 % VRN      |                          |         |                   |                              |                                     | 296.000                  | USD     | 261.145           | 0,03                         |
| 18.01.33                    | 1.600.000                | USD     | 1.486.932         | 0,17                         |                                     |                          |         | <b>1.320.192</b>  | <b>0,15</b>                  |
| CEMEX 5,125 % VRN PERP      | 500.000                  | USD     | 482.944           | 0,05                         | <b>PERU</b>                         |                          |         |                   |                              |
| MEXICO (GOVT) 3,5 %         |                          |         |                   |                              | <b>BANCO INTERNACIONAL DEL</b>      |                          |         |                   |                              |
| 12/02/2034                  | 1.789.000                | USD     | 1.493.273         | 0,17                         | <b>PERU 3,25 % 04.10.26</b>         |                          |         |                   |                              |
| MEXICO (GOVT) 3,771 %       |                          |         |                   |                              |                                     | 700.000                  | USD     | 660.957           | 0,07                         |
| 24.05.61                    | 1.650.000                | USD     | 1.076.385         | 0,12                         | <b>FONDO MIVIVIENDA 4,625 %</b>     |                          |         |                   |                              |
| MEXICO (GOVT) 4,5 %         |                          |         |                   |                              | <b>12/04/2027</b>                   |                          |         |                   |                              |
| 22.04.29                    | 1.150.000                | USD     | 1.114.097         | 0,13                         |                                     | 1.300.000                | USD     | 1.266.754         | 0,14                         |
| MEXICO (GOVT) 4,75 %        |                          |         |                   |                              | <b>HUNT OIL PERU 6,375 %</b>        |                          |         |                   |                              |
| 27.04.32                    | 2.170.000                | USD     | 2.062.191         | 0,22                         | <b>01/06/2028</b>                   |                          |         |                   |                              |
| MEXICO (GOVT) 5 %           |                          |         |                   |                              |                                     | 906.000                  | USD     | 707.975           | 0,08                         |
| 27.04.51                    | 420.000                  | USD     | 354.501           | 0,04                         | <b>PERU (GOVT) 3 % 15.01.2034</b>   |                          |         |                   |                              |
| MEXICO (GOVT) 6 %           |                          |         |                   |                              | <b>PERU (GOVT) 3,3 %</b>            |                          |         |                   |                              |
| 07/05/2036                  | 800.000                  | USD     | 804.504           | 0,09                         |                                     | 780.000                  | USD     | 586.905           | 0,07                         |
| TRUST 4,869 % 15.01.30      | 650.000                  | USD     | 580.959           | 0,07                         | <b>PERU (GOVT) 4,125 %</b>          |                          |         |                   |                              |
|                             |                          |         | <b>10.757.961</b> | <b>1,21</b>                  | <b>25.08.27</b>                     |                          |         |                   |                              |
|                             |                          |         |                   |                              |                                     |                          |         | <b>4.809.021</b>  | <b>0,54</b>                  |
| <b>NIEDERLANDE</b>          |                          |         |                   |                              | <b>PORTUGAL</b>                     |                          |         |                   |                              |
| ALCOA NEDERLAND HOLDING     |                          |         |                   |                              | <b>EDP ENERGIAS DE PORTUGAL</b>     |                          |         |                   |                              |
| 7,125 % 15.03.31            | 824.000                  | USD     | 840.162           | 0,09                         | <b>1,875 % VRN 14.03.82</b>         |                          |         |                   |                              |
| ENEL FINANCE INTERNATIONAL  |                          |         |                   |                              |                                     | 3.000.000                | EUR     | 2.794.444         | 0,32                         |
| 4,75 % 25.05.47             | 1.620.000                | USD     | 1.392.736         | 0,16                         |                                     |                          |         | <b>2.794.444</b>  | <b>0,32</b>                  |
| ENEL FINANCE INTERNATIONAL  |                          |         |                   |                              | <b>SÜDAFRIKA</b>                    |                          |         |                   |                              |
| 5,5 % 15.06.52              | 555.000                  | USD     | 522.261           | 0,06                         | <b>SOUTH AFRICA (GOVT)</b>          |                          |         |                   |                              |
| IBERDROLA INTERNATIONAL     |                          |         |                   |                              | <b>4,3 % 12.10.28</b>               |                          |         |                   |                              |
| 3,25 % VRN PERP             | 3.000.000                | EUR     | 3.209.252         | 0,35                         |                                     | 1.695.000                | USD     | 1.524.574         | 0,17                         |
| ING GROEP 2,125 % VRN       |                          |         |                   |                              |                                     |                          |         | <b>1.524.574</b>  | <b>0,17</b>                  |
| 26.05.31                    | 1.800.000                | EUR     | 1.867.100         | 0,21                         | <b>SCHWEIZ</b>                      |                          |         |                   |                              |
|                             |                          |         |                   |                              | <b>SWISS LIFE 4,375 % VRN</b>       |                          |         |                   |                              |
|                             |                          |         |                   |                              | <b>PERP</b>                         |                          |         |                   |                              |
|                             |                          |         |                   |                              |                                     | 3.400.000                | EUR     | 3.654.863         | 0,41                         |
|                             |                          |         |                   |                              |                                     |                          |         | <b>3.654.863</b>  | <b>0,41</b>                  |
|                             |                          |         |                   |                              | <b>VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE</b> |                          |         |                   |                              |
|                             |                          |         |                   |                              | <b>ABU DHABI CRUDE OIL</b>          |                          |         |                   |                              |
|                             |                          |         |                   |                              |                                     | 200.000                  | USD     | 179.870           | 0,02                         |
|                             |                          |         |                   |                              |                                     |                          |         | <b>179.870</b>    | <b>0,02</b>                  |
|                             |                          |         |                   |                              | <b>PIPELINE 4,6 % 02.11.2047</b>    |                          |         |                   |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global High Income Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert  | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|-----------|------------------------------|--|--------------------------|---------|-----------|------------------------------|
| <b>USA</b>  |                          |         |           |                              | CHARTER COMMUNICATIONS OPERATING                     |                          |         |           |                              |
| AAR ESCROW ISSUER 6,75 %<br>15.03.29                          | 331.000                  | USD     | 334.167   | 0,04                         | 5,75 % 01.04.48                                      | 1.760.000                | USD     | 1.485.139 | 0,17                         |
| AIRCASTLE 5,25 %<br>11/08/2025                                | 2.500.000                | USD     | 2.478.102 | 0,28                         | CHARTER COMMUNICATION OPERATING<br>6,484 % 23.10.45  | 775.000                  | USD     | 720.868   | 0,08                         |
| ALLY FINANCIAL 4,7 % VRN<br>PERP                              | 2.133.000                | USD     | 1.834.126 | 0,21                         | CHENIERE ENERGY<br>PARTNERS 3,25 % 31.01.32          | 1.250.000                | USD     | 1.065.810 | 0,12                         |
| AMER SPORTS 6,75 %<br>16.02.31                                | 1.190.000                | USD     | 1.187.890 | 0,13                         | CHSCOMMUNITY HEALTH<br>SYSTEMS 8 % 15.03.2026        | 3.258.000                | USD     | 3.250.590 | 0,37                         |
| AMERICAN AIRLINES ADVANTAGE<br>5,75 % 20.04.29                | 2.000.000                | USD     | 1.969.849 | 0,22                         | CITIGROUP 4,7 % VRN PERP<br>CITIGROUP 5,827 % VRN    | 800.000                  | USD     | 783.399   | 0,09                         |
| ANTERO MIDSTREAM PARTNERS<br>6,625 % 01.02.32                 | 2.000.000                | USD     | 2.012.883 | 0,23                         | 13.02.35   | 1.070.000                | USD     | 1.059.979 | 0,12                         |
| ARDAGH PACKAGING<br>FINANCE 4,125 % 15.08.2026                | 1.700.000                | USD     | 1.544.703 | 0,17                         | CIVITAS RESOURCES<br>8,625 % 01.11.30                | 1.408.000                | USD     | 1.512.643 | 0,17                         |
| ATHENE GLOBAL FUNDING<br>1 % 16.04.24                         | 505.000                  | USD     | 504.032   | 0,06                         | CLEVELANDCLIFFS 6,75 %<br>15.04.30                   | 1.500.000                | USD     | 1.508.460 | 0,17                         |
| AVIATION CAPITAL GROUP<br>1,95 % 20.09.26                     | 3.130.000                | USD     | 2.862.767 | 0,32                         | DAE FUNDING 1,55 %<br>01/08/2024                     | 675.000                  | USD     | 665.234   | 0,08                         |
| AVIS BUDGET CAR RENTAL<br>8 % 15.02.31                        | 5.500.000                | USD     | 5.494.724 | 0,63                         | DANA 4,5 % 15.02.32                                  | 1.500.000                | USD     | 1.301.865 | 0,15                         |
| AVOLON HOLDINGS FUNDING<br>5,5 % 15.01.26                     | 1.800.000                | USD     | 1.784.135 | 0,20                         | DELL INTERNATIONAL 5,4 %<br>15.04.34                 | 1.500.000                | USD     | 1.503.621 | 0,17                         |
| BANK OF AMERICA 2,482 %<br>VRN 21.09.36                       | 4.440.000                | USD     | 3.552.357 | 0,40                         | DELL INTERNATIONAL<br>6,02 % 15.06.26                | 633.000                  | USD     | 641.713   | 0,07                         |
| BERRY GLOBAL 5,65 %<br>15.01.34                               | 2.000.000                | USD     | 1.991.918 | 0,22                         | DELTA AIR LINES 4,75 %<br>20.10.28                   | 1.000.000                | USD     | 978.502   | 0,11                         |
| BROADCOM 3,187 %<br>15.11.36                                  | 2.557.000                | USD     | 2.039.673 | 0,23                         | DIRECTV FINANCING<br>8,875 % 01.02.30                | 1.000.000                | USD     | 998.687   | 0,11                         |
| BROADCOM 4,15 % 15.11.30                                      | 421.000                  | USD     | 398.786   | 0,05                         | DISCOVERY COMMUNICATIONS<br>4 % 15.09.55             | 500.000                  | USD     | 342.680   | 0,04                         |
| BROADCOM 4,15 % 15.04.32                                      | 1.900.000                | USD     | 1.765.194 | 0,20                         | ENCOMPASS HEALTH 4,5 %<br>01/02/2028                 | 2.500.000                | USD     | 2.382.308 | 0,27                         |
| BUCKEYE PARTNERS 5,85 %<br>15.11.43                           | 1.150.000                | USD     | 978.089   | 0,11                         | ENERGY TRANSFER<br>PARTNERS 5,3 % 15.04.47           | 1.425.000                | USD     | 1.301.917 | 0,15                         |
| BUILDERS FIRSTSOURCE<br>6,375 % 01.03.34                      | 2.000.000                | USD     | 2.008.840 | 0,23                         | ENTERPRISE PRODUCTS OPERATING<br>5,25 % VRN 16.08.77 | 2.150.000                | USD     | 2.047.571 | 0,23                         |
| CALLON PETROLEUM 7,5 %<br>15.06.30                            | 1.000.000                | USD     | 1.060.413 | 0,12                         | EPR PROPERTIES 3,6 %<br>15.11.31                     | 750.000                  | USD     | 628.282   | 0,07                         |
| CARE CAPITAL PROPERTIES<br>5,125 % 15.08.26                   | 3.700.000                | USD     | 3.674.336 | 0,41                         | EPR PROPERTIES 4,95 %<br>15.04.28                    | 4.000.000                | USD     | 3.813.024 | 0,43                         |
| CARNIVAL HOLDINGS<br>BERMUDA 10,375 % 01.05.2028              | 2.500.000                | USD     | 2.729.752 | 0,31                         | EQM MIDSTREAM PARTNERS<br>6,375 % 01.04.29           | 344.000                  | USD     | 346.899   | 0,04                         |
| CCO HOLDINGS 7,375 %<br>01/03/2031                            | 7.500.000                | USD     | 7.361.149 | 0,84                         | EQM MIDSTREAM PARTNERS<br>7,5 % 01.06.30             | 1.000.000                | USD     | 1.070.447 | 0,12                         |
| CENTENE 4,625 % 15.12.29                                      | 4.000.000                | USD     | 3.803.750 | 0,43                         | ESAB 6,25 % 15.04.29                                 | 403.000                  | USD     | 405.463   | 0,05                         |
| CENTENNIAL RESOURCE PRO-<br>DUCTION 6,875 % 01.04.2027        | 1.000.000                | USD     | 1.000.000 | 0,11                         | FISERV 5,35 % 15.03.31                               | 410.000                  | USD     | 415.209   | 0,05                         |
| CHART INDUSTRIES 7,5 %<br>01/01/2030                          | 100.000                  | USD     | 103.947   | 0,01                         | FIVE CORNERS FUNDING<br>TRUST 5,997 % 15.02.53       | 1.710.000                | USD     | 1.815.082 | 0,20                         |
| CHARTER COMMUNICATIONS<br>OPERATING 3,5 % 01.03.42            | 1.440.000                | USD     | 965.040   | 0,11                         | FORD MOTOR 3,25 %<br>12/02/2032                      | 2.000.000                | USD     | 1.666.999 | 0,19                         |
| CHARTER COMMUNICATION OPERATING<br>CAPITAL 5,375 % 01.05.2047 | 385.000                  | USD     | 311.341   | 0,04                         | GENERAL MOTORS 6,75 %<br>01/04/2046                  | 902.000                  | USD     | 976.401   | 0,11                         |
|   |                          |         |           |                              | GLP CAPITAL 6,75 % 12.01.2033                        | 545.000                  | USD     | 574.920   | 0,06                         |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global High Income Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapiieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung                                       | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert  | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung                                     | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--------------------------|---------|-----------|------------------------------|--|--------------------------|---------|--------------------|------------------------------|
| GPC MERGER 7,125 %<br>15.08.28                     | 2.398.000                | USD     | 2.178.192 | 0,25                         | SASOL FINANCING 6,5 %<br>26.09.28                | 300.000                  | USD     | 286.697            | 0,03                         |
| HCA 3,5 % 15.07.51                                 | 2.500.000                | USD     | 1.730.933 | 0,20                         | SEAGATE 8,25 % 15.12.29                          | 1.000.000                | USD     | 1.076.636          | 0,12                         |
| IQVIA 5,7 % 15.05.2028                             | 5.500.000                | USD     | 5.593.426 | 0,64                         | SIERRACOL ENERGY ANDINA<br>6 % 15.06.28          | 1.250.000                | USD     | 1.099.605          | 0,12                         |
| IRON MOUNTAIN 7 %<br>15.02.29                      | 2.000.000                | USD     | 2.040.309 | 0,23                         | SUNOCO FINANCE 7 %<br>15.09.28                   | 2.890.000                | USD     | 2.956.944          | 0,33                         |
| JPMORGAN CHASE 5 % VRN<br>PERP                     | 1.575.000                | USD     | 1.572.542 | 0,18                         | TALLGRASS ENERGY<br>PARTNERS 6 % 01.09.31        | 1.000.000                | USD     | 934.554            | 0,11                         |
| JPMORGAN CHASE 6,1 % VRN<br>PERP                   | 1.925.000                | USD     | 1.927.316 | 0,22                         | TALLGRASS ENERGY PARTNERS<br>7,375 % 15.02.29    | 1.166.000                | USD     | 1.173.532          | 0,13                         |
| KENNAMETAL 2,8 %<br>01/03/2031                     | 445.000                  | USD     | 378.192   | 0,04                         | TARGA RESOURCES<br>PARTNERS 5,5 % 01.03.30       | 3.000.000                | USD     | 2.986.726          | 0,34                         |
| KINETIK HOLDINGS 5,875 %<br>15.06.30               | 1.250.000                | USD     | 1.224.005 | 0,14                         | TAYLOR MORRISON COMMUNITIES<br>5,75 % 15.01.28   | 1.000.000                | USD     | 995.180            | 0,11                         |
| KOSMOS ENERGY 7,75 %<br>01/05/2027                 | 1.350.000                | USD     | 1.334.493 | 0,15                         | TENET HEALTHCARE 5,125 %<br>01/11/2027           | 926.000                  | USD     | 906.404            | 0,10                         |
| KRAFT FOODS GROUP 5 %<br>04/06/2042                | 2.800.000                | USD     | 2.634.806 | 0,30                         | TIME WARNER CABLE 4,5 %<br>15.09.42              | 1.300.000                | USD     | 964.462            | 0,11                         |
| LABL 9,5 % 01.11.28                                | 4.725.000                | USD     | 4.790.788 | 0,54                         | TRANSDIGM 6,625 %<br>01/03/2032                  | 2.150.000                | USD     | 2.173.338          | 0,25                         |
| MACYS RETAIL HOLDINGS<br>5,875 % 01.04.29          | 1.000.000                | USD     | 982.165   | 0,11                         | TRANSDIGM 6,875 %<br>15.12.30                    | 2.000.000                | USD     | 2.041.738          | 0,23                         |
| MATADOR RESOURCES<br>5,875 % 15.09.26              | 1.000.000                | USD     | 1.001.386 | 0,11                         | TRONOX 4,625 % 15.03.29                          | 100.000                  | USD     | 89.872             | 0,01                         |
| MATADOR RESOURCES 6,5 %<br>15.04.32                | 1.000.000                | USD     | 1.004.428 | 0,11                         | UNITED AIRLINES 5,875 %<br>15.04.29              | 7.000.000                | USD     | 4.182.015          | 0,47                         |
| MEDLINE BORROWER<br>LPMEDLINE 6,25 % 01.04.2029    | 818.000                  | USD     | 822.690   | 0,09                         | US (GOVT) 1,125 %<br>15.01.25                    | 500.000                  | USD     | 484.746            | 0,05                         |
| MILEAGE PLUS HOLDINGS<br>6,5 % 20.06.27            | 1.000.000                | USD     | 705.467   | 0,08                         | US (GOVT) 2 % 15.08.51                           | 300.000                  | USD     | 186.563            | 0,02                         |
| MODIVCARE ESCROW ISSUER<br>5 % 01.10.29            | 1.518.000                | USD     | 1.102.476 | 0,12                         | US (GOVT) 4 % 15.02.34                           | 5.600.000                | USD     | 5.516.438          | 0,63                         |
| MORGAN STANLEY 2,484 %<br>VRN 16.09.36             | 470.000                  | USD     | 371.981   | 0,04                         | US (GOVT) 4,25 % 30.09.24                        | 2.000.000                | USD     | 1.990.195          | 0,22                         |
| MPLX 5,2 % 01.03.47                                | 1.830.000                | USD     | 1.683.148 | 0,19                         | US (GOVT) 4,25 % 28.02.29                        | 4.550.000                | USD     | 4.560.486          | 0,51                         |
| MPT OPERATING PARTNERSHIP<br>3,325 % 24.03.25      | 2.300.000                | EUR     | 2.344.684 | 0,26                         | VENTURE GLOBAL 8,375 %<br>01/06/2031             | 5.000.000                | USD     | 5.167.305          | 0,58                         |
| MSCI 3,625 % 01.09.30                              | 1.000.000                | USD     | 889.125   | 0,10                         | VENTURE GLOBAL 9,875 %<br>01/02/2032             | 2.403.000                | USD     | 2.593.695          | 0,29                         |
| MSCI 4 % 15.11.29                                  | 2.500.000                | USD     | 2.317.500 | 0,26                         | VENTURE GLOBAL CALCASIEU<br>PASS 6,25 % 15.01.30 | 2.000.000                | USD     | 2.014.424          | 0,23                         |
| NCR ATLEOS ESCROW 9,5 %<br>01/04/2029              | 2.000.000                | USD     | 2.140.512 | 0,24                         | VICI PROPERTIES 4,125 %<br>15.08.30              | 1.500.000                | USD     | 1.368.502          | 0,15                         |
| NEWMONT CORP NEWCREST<br>FINANCE 5,35 % 15.03.34   | 800.000                  | USD     | 805.572   | 0,09                         | VINE ENERGY HOLDINGS<br>6,75 % 15.04.29          | 5.500.000                | USD     | 5.565.913          | 0,64                         |
| NEXTERA ENERGY CAPITAL<br>HOLDINGS 5,55 % 15.03.54 | 2.000.000                | USD     | 1.992.420 | 0,22                         | WAND NEWCO 7,625 %<br>30.01.32                   | 171.000                  | USD     | 177.114            | 0,02                         |
| NIAGARA MOHAWK POWER<br>5,664 % 17.01.54           | 315.000                  | USD     | 314.577   | 0,04                         | WARNERMEDIA HOLDINGS<br>5,05 % 15.03.42          | 500.000                  | USD     | 430.009            | 0,05                         |
| OCCIDENTAL PETROLEUM<br>6,2 % 15.03.40             | 625.000                  | USD     | 641.430   | 0,07                         | WESTERN MIDSTREAM<br>OPERATING 5,25 % 01.02.50   | 2.500.000                | USD     | 2.241.959          | 0,25                         |
| PENNYMAC FINANCIAL<br>SERVICES 7,875 % 15.12.29    | 1.000.000                | USD     | 1.028.744 | 0,12                         | WR GRACE HOLDINGS<br>7,375 % 01.03.31            | 1.832.000                | USD     | 1.860.952          | 0,21                         |
| PERMIAN RESOURCES<br>OPERATING 7 % 15.01.32        | 750.000                  | USD     | 778.057   | 0,09                         |  |                          |         | <b>193.373.043</b> | <b>21,84</b>                 |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global High Income Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung                            | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung                                       | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|--------------------|------------------------------|--|--------------------------|---------|--------------------|------------------------------|
| <b>URUGUAY</b>                          |                          |         |                    |                              | BF MORTGAGE TRUST FRN                              |                          |         |                    |                              |
| URUGUAY (GOVT) 4,375 %                  |                          |         |                    |                              | 15.12.35   | 1.400.000                | USD     | 1.177.856          | 0,13                         |
| 23.01.31                                | 4.050.000                | USD     | 3.970.651          | 0,45                         | BX TRUST 6,3 % 13.10.2027                          | 1.000.000                | USD     | 943.240            | 0,11                         |
|   |                          |         | <b>3.970.651</b>   | <b>0,45</b>                  | BX TRUST FRN 25.11.2028                            | 2.240.000                | USD     | 1.561.676          | 0,18                         |
| <b>SUMME ANLEIHEN</b>                   |                          |         | <b>329.444.297</b> | <b>37,20</b>                 | CAMB COMMERCIAL MORTGAGE                           |                          |         |                    |                              |
|   |                          |         |                    |                              | TRUST FRN 15.12.37                                 | 1.051.000                | USD     | 1.051.215          | 0,12                         |
| <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b> |                          |         |                    |                              | CAMB COMMERCIAL                                    |                          |         |                    |                              |
| <b>CHINA</b>                            |                          |         |                    |                              | MORTGAGE TRUST FRN                                 |                          |         |                    |                              |
| ATRIUM XV FRN                           |                          |         |                    |                              | 15.12.2037 (US12482HAN44)                          | 1.445.000                | USD     | 1.442.884          | 0,16                         |
| 01/23/2031                              | 1.500.000                | USD     | 1.500.540          | 0,17                         | CONNECTICUT AVENUE SECURITIES                      |                          |         |                    |                              |
|   |                          |         | <b>1.500.540</b>   | <b>0,17</b>                  | TRUST FRN 25.06.43                                 | 1.000.000                | USD     | 853.844            | 0,10                         |
| <b>GROSSBRITANNIEN</b>                  |                          |         |                    |                              | CONNECTICUT AVENUE SECURITIES                      |                          |         |                    |                              |
| LANARK MASTER FRN                       |                          |         |                    |                              | TRUST FRN 25.02.44                                 | 1.000.000                | USD     | 1.005.650          | 0,11                         |
| 22.12.69                                | 2.000.000                | GBP     | 2.532.611          | 0,29                         | CORE MORTGAGE TRUST FRN                            |                          |         |                    |                              |
|   |                          |         | <b>2.532.611</b>   | <b>0,29</b>                  | 15.12.31   | 1.500.000                | USD     | 1.112.293          | 0,13                         |
| <b>IRLAND</b>                           |                          |         |                    |                              | DBGS MORTGAGE TRUST FRN                            |                          |         |                    |                              |
| BERG FINANCE FRN                        |                          |         |                    |                              | 15.05.2035 (US23306GAG29)                          | 1.000.000                | USD     | 905.783            | 0,10                         |
| 22.07.33                                | 1.600.000                | EUR     | 285.069            | 0,03                         | FREDDIE MAC STACR REMIC                            |                          |         |                    |                              |
| CARLYLE US CLO FRN                      |                          |         |                    |                              | TRUST FRN 25.10.33                                 | 1.631.000                | USD     | 1.660.743          | 0,19                         |
| 20.07.31                                | 1.000.000                | USD     | 961.064            | 0,11                         | FREDDIE MAC STACR REMIC                            |                          |         |                    |                              |
| INVESCO CLO FRN                         |                          |         |                    |                              | TRUST FRN 25.02.44                                 | 1.500.000                | USD     | 1.506.549          | 0,17                         |
| 15.08.34                                | 2.000.000                | EUR     | 2.051.366          | 0,23                         | GALAXY CLO FRN                                     |                          |         |                    |                              |
| LAST MILE LOGISTICS FRN                 |                          |         |                    |                              | 22/11/2031   | 2.000.000                | USD     | 1.993.192          | 0,23                         |
| 17.08.26                                | 1.610.000                | EUR     | 1.620.011          | 0,18                         | HOME PARTNERS OF                                   |                          |         |                    |                              |
| PENTA CLO FRN 20.04.2035                | 1.000.000                | EUR     | 1.080.921          | 0,12                         | AMERICA 2,852 % 17.12.26                           | 1.000.000                | USD     | 865.050            | 0,10                         |
| TAURUS FRN 17.05.2031                   | 1.000.000                | GBP     | 1.205.759          | 0,14                         | HUDSON YARDS MORTGAGE                              |                          |         |                    |                              |
|   |                          |         | <b>7.204.190</b>   | <b>0,81</b>                  | 3,557 % VRN 10.07.39                               | 1.243.000                | USD     | 1.002.966          | 0,11                         |
| <b>ITALIEN</b>                          |                          |         |                    |                              | INVESCO CLO FRN                                    |                          |         |                    |                              |
| ERNA FRN 25.07.2031                     | 2.279.000                | EUR     | 1.127.631          | 0,13                         | 22.04.37   | 1.500.000                | USD     | 1.506.818          | 0,17                         |
|   |                          |         | <b>1.127.631</b>   | <b>0,13</b>                  | MORGAN STANLEY CAPITAL                             |                          |         |                    |                              |
| <b>NIEDERLANDE</b>                      |                          |         |                    |                              | I TRUST VRN 05.02.2035                             | 4.600.000                | USD     | 3.479.037          | 0,38                         |
| JUBILEE CLO FRN                         |                          |         |                    |                              | PEEBLES CLO PARK FRN                               |                          |         |                    |                              |
| 15/06/2032                              | 1.700.000                | EUR     | 1.854.628          | 0,21                         | 21.04.37   | 1.500.000                | USD     | 1.500.000          | 0,17                         |
|   |                          |         | <b>1.854.628</b>   | <b>0,21</b>                  | PIKES PEAK CLO FRN                                 |                          |         |                    |                              |
| <b>USA</b>                              |                          |         |                    |                              | 25.10.34   | 500.000                  | USD     | 490.566            | 0,06                         |
| 280 PARK AVENUE                         |                          |         |                    |                              | PREFERRED TERM FRN                                 |                          |         |                    |                              |
| MORTGAGE FRN 15.09.2034                 | 1.400.000                | USD     | 1.299.358          | 0,15                         | 22.09.36   | 2.750.000                | USD     | 205.056            | 0,02                         |
| AGL CLO FRN 21.04.2037                  | 2.000.000                | USD     | 2.005.854          | 0,23                         | PROGRESS RESIDENTIAL                               |                          |         |                    |                              |
| ALIGNED DATA CENTERS                    |                          |         |                    |                              | 2,409 % 17.05.38                                   | 1.000.000                | USD     | 914.183            | 0,10                         |
| ISSUER 2,482 % 15.08.46                 | 750.000                  | USD     | 672.003            | 0,08                         | PROGRESS RESIDENTIAL                               |                          |         |                    |                              |
| AMMC CLO FRN 11.02.2030                 | 2.300.000                | USD     | 2.288.707          | 0,25                         | 3,945 % 17.04.27                                   | 2.000.000                | USD     | 1.877.469          | 0,21                         |
| AMMC CLO FRN 26.05.31                   | 500.000                  | USD     | 497.068            | 0,06                         | VENTURE 28A CLO FRN                                |                          |         |                    |                              |
| APIDOS CLO XXXVII FRN                   |                          |         |                    |                              | 20.10.34   | 500.000                  | USD     | 481.236            | 0,05                         |
| 22/10/2034                              | 2.000.000                | USD     | 1.972.332          | 0,22                         | WHETSTONE PARK CLO FRN                             |                          |         |                    |                              |
| BAIN CAPITAL CREDIT CLO                 |                          |         |                    |                              | 20.01.35   | 1.500.000                | USD     | 1.484.355          | 0,17                         |
| FRN 18.04.34                            | 1.000.000                | USD     | 977.038            | 0,11                         | WHETSTONE PARK CLO FRN                             |                          |         |                    |                              |
| BAMLL COMMERCIAL MORTGAGE               |                          |         |                    |                              | 20.01.2035 (US96330AAA43)                          | 1.000.000                | USD     | 967.417            | 0,11                         |
| 3,7157 % VRN 14.04.33                   | 1.000.000                | USD     | 955.708            | 0,11                         |  |                          |         | <b>42.699.173</b>  | <b>4,82</b>                  |
| BAMLL MORTGAGE TRUST                    |                          |         |                    |                              | <b>SUMME FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>      |                          |         | <b>56.918.773</b>  | <b>6,43</b>                  |
| 3,5958 % VRN 14.04.33                   | 1.220.000                | USD     | 1.154.183          | 0,13                         | <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN</b>                |                          |         | <b>386.363.070</b> | <b>43,63</b>                 |
| BBCMS MORTGAGE TRUST                    |                          |         |                    |                              | <b>MARKT GEHANDELTEN ÜBERTRAGBAREN WERTPAPIERE</b> |                          |         |                    |                              |
| FRN 15.03.37                            | 1.000.000                | USD     | 887.844            | 0,10                         |  |                          |         |                    |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global High Income Bond (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung                                      | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung                                   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|--|--------------------------|---------|--------------------|------------------------------|
| <b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>          |                          |         |                   |                              | <b>COMM MORTGAGE TRUST 0 %</b>                 |                          |         |                    |                              |
| <b>IRLAND</b>                                     |                          |         |                   |                              | 31.12.40                                       | 1.000.000                | USD     | 819.039            | 0,09                         |
| HSBC GLOBAL LIQUIDITY<br>FUND                     | 15.460.379               | USD     | 15.460.379        | 1,75                         | MADISON PARK FUNDING<br>FRN 21.07.30           | 2.000.000                | USD     | 2.000.166          | 0,23                         |
| HSBC US DOLLAR ESG<br>LIQUIDITY FUND Y INC        | 4.261.211                | USD     | 4.261.211         | 0,48                         | PROGRESS RESIDENTIAL<br>4,451 % 20.07.39       | 1.000.000                | USD     | 975.999            | 0,11                         |
|   |                          |         | <b>19.721.590</b> | <b>2,23</b>                  |  |                          |         | <b>5.826.255</b>   | <b>0,66</b>                  |
| <b>SUMME ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>    |                          |         | <b>19.721.590</b> | <b>2,23</b>                  | <b>SUMME FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>  |                          |         | <b>8.962.259</b>   | <b>1,01</b>                  |
| <b>GELDMARKTINSTRUMENTE</b>                       |                          |         |                   |                              | <b>SUMME SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |                          |         | <b>8.987.699</b>   | <b>1,01</b>                  |
| <b>SCHATZWECHSEL</b>                              |                          |         |                   |                              | <b>SUMME WERTPAPIERANLAGEN</b>                 |                          |         | <b>855.127.065</b> | <b>96,56</b>                 |
| <b>USA</b>  |                          |         |                   |                              | <b>SONSTIGES NETTOVERMÖGEN</b>                 |                          |         | <b>30.465.617</b>  | <b>3,44</b>                  |
| US (GOVT) 0 % 09.07.24                            | 2.000.000                | USD     | 1.971.469         | 0,22                         | <b>GESAMTNETTOVERMÖGEN</b>                     |                          |         | <b>885.592.682</b> | <b>100,00</b>                |
|   |                          |         | <b>1.971.469</b>  | <b>0,22</b>                  |  |                          |         |                    |                              |
| <b>SUMME SCHATZWECHSEL</b>                        |                          |         | <b>1.971.469</b>  | <b>0,22</b>                  |  |                          |         |                    |                              |
| <b>GELDMARKTINSTRUMENTE GESAMT</b>                |                          |         | <b>1.971.469</b>  | <b>0,22</b>                  |  |                          |         |                    |                              |
| <b>SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>          |                          |         |                   |                              |  |                          |         |                    |                              |
| <b>ANLEIHEN</b>                                   |                          |         |                   |                              |  |                          |         |                    |                              |
| <b>USA</b>  |                          |         |                   |                              |  |                          |         |                    |                              |
| SUNAC CHINA HOLDINGS<br>7,25 % 31.12.2049*****    | 300.000                  | USD     | 25.440            | 0,00                         |  |                          |         |                    |                              |
|   |                          |         | <b>25.440</b>     | <b>0,00</b>                  |  |                          |         |                    |                              |
| <b>SUMME ANLEIHEN</b>                             |                          |         | <b>25.440</b>     | <b>0,00</b>                  |  |                          |         |                    |                              |
| <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>           |                          |         |                   |                              |  |                          |         |                    |                              |
| <b>AUSTRALIEN</b>                                 |                          |         |                   |                              |  |                          |         |                    |                              |
| KINGFISHER TRUST 2016<br>FRN 24.11.48             | 3.500.000                | AUD     | 793.273           | 0,09                         |  |                          |         |                    |                              |
| LA TROBE FINANCIAL CAPITAL<br>MARKET FRN 14.05.55 | 3.000.000                | AUD     | 1.971.278         | 0,22                         |  |                          |         |                    |                              |
| PROGRESS TRUST FRN<br>21.02.48                    | 2.000.000                | AUD     | 371.453           | 0,04                         |  |                          |         |                    |                              |
|   |                          |         | <b>3.136.004</b>  | <b>0,35</b>                  |  |                          |         |                    |                              |
| <b>USA</b>  |                          |         |                   |                              |  |                          |         |                    |                              |
| ALESCO PREFERRED<br>FUNDING FRN 23.12.2034        | 7.000.000                | USD     | 124.245           | 0,01                         |  |                          |         |                    |                              |
| APIDOS CLO FRN 15.04.33                           | 2.000.000                | USD     | 1.906.806         | 0,22                         |  |                          |         |                    |                              |

\*\*\*\*\* Der Ausschuss für die Preisbestimmung und die Verwaltungsgesellschaft haben vereinbart und veranlasst, den beizulegenden Zeitwert des Wertpapiers auf 25.440 USD festzusetzen.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global High Yield Bond

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung                               | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|------------------|------------------------------|--|--------------------------|---------|------------------|------------------------------|
| <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>  |                          |         |                  |                              | <b>DÄNEMARK</b>                            |                          |         |                  |                              |
| <b>AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |                          |         |                  |                              | ORSTED 5,125 % VRN<br>14.03.24             |                          |         |                  |                              |
|   |                          |         |                  |                              |  | 500.000                  | EUR     | 543.881          | 0,07                         |
|   |                          |         |                  |                              |  |                          |         | <b>543.881</b>   | <b>0,07</b>                  |
| <b>ANLEIHEN</b>   |                          |         |                  |                              | <b>FINNLAND</b>                            |                          |         |                  |                              |
| <b>ÖSTERREICH</b>   |                          |         |                  |                              | HUHTAMAKI 4,25 %<br>09/06/2027             |                          |         |                  |                              |
| ERSTE GROUP BANK 4,25 %<br>VRN PERP                               | 1.800.000                | EUR     | 1.756.518        | 0,25                         |  | 600.000                  | EUR     | 653.140          | 0,09                         |
| SAPPI PAPIER HOLDING<br>3,625 % 15.03.28                          | 650.000                  | EUR     | 677.700          | 0,09                         | HUHTAMAKI 5,125 %<br>24.11.28              | 1.000.000                | EUR     | 1.120.735        | 0,15                         |
|   |                          |         | <b>2.434.218</b> | <b>0,34</b>                  |  |                          |         | <b>1.773.875</b> | <b>0,24</b>                  |
| <b>BELGIEN</b>  |                          |         |                  |                              | <b>FRANKREICH</b>                          |                          |         |                  |                              |
| BELFIUS BANK 3,625 % VRN<br>PERP                                  | 1.200.000                | EUR     | 1.207.920        | 0,17                         | BNP PARIBAS 7,375 % VRN<br>PERP            | 800.000                  | EUR     | 926.058          | 0,13                         |
| KBC GROUP 4,25 % VRN PERP   | 3.200.000                | EUR     | 3.303.207        | 0,45                         | CROWN EUROPEAN HOLDINGS<br>4,75 % 15.03.29 | 1.150.000                | EUR     | 1.262.827        | 0,17                         |
|   |                          |         | <b>4.511.127</b> | <b>0,62</b>                  | CROWN EUROPEAN HOLDINGS<br>5 % 15.05.28    | 800.000                  | EUR     | 888.974          | 0,12                         |
| <b>BRASILIEN</b>  |                          |         |                  |                              | ELECTRICITE DE FRANCE<br>2,875 % VRN PERP  |                          |         |                  |                              |
| BRF 5,75 % 21.09.50   | 700.000                  | USD     | 557.673          | 0,08                         | ELECTRICITE DE FRANCE<br>4 % VRN PERP      | 1.200.000                | EUR     | 1.289.250        | 0,18                         |
|   |                          |         | <b>557.673</b>   | <b>0,08</b>                  | ELECTRICITE DE FRANCE<br>7,5 % VRN PERP    | 1.600.000                | EUR     | 1.879.800        | 0,26                         |
| <b>KANADA</b>   |                          |         |                  |                              | ELIS 1,625 % 03.04.28                      |                          |         |                  |                              |
| BOMBARDIER 7,125 %<br>15.06.26                                    | 776.000                  | USD     | 788.473          | 0,11                         | ERAMET 7 % 22.05.28                        | 300.000                  | EUR     | 325.587          | 0,04                         |
| BOMBARDIER 7,875 %<br>15.04.27                                    | 2.215.000                | USD     | 2.219.887        | 0,31                         | FAURECIA 2,375 %<br>15.06.27               | 1.300.000                | EUR     | 1.327.577        | 0,18                         |
| NOVA CHEMICALS 8,5 %<br>15.11.28                                  | 1.167.000                | USD     | 1.243.885        | 0,17                         | FNAC DARTY 6 % 01.04.2029                  | 245.000                  | EUR     | 274.193          | 0,04                         |
|   |                          |         | <b>4.252.245</b> | <b>0,59</b>                  | GOLDSTORY 6,75 %<br>01/02/2030             | 783.000                  | EUR     | 865.300          | 0,12                         |
| <b>CHINA</b>  |                          |         |                  |                              | ILIAD 5,375 % 14.06.27                     |                          |         |                  |                              |
| CIFI HOLDINGS GROUP<br>5,95 % 20.10.25                            | 370.000                  | USD     | 31.403           | 0,00                         | ILIAD 5,375 % 15.02.29                     | 2.400.000                | EUR     | 2.650.683        | 0,37                         |
| TIMES CHINA HOLDINGS<br>5,75 % 14.01.27                           | 1.200.000                | USD     | 36.657           | 0,01                         | LA BANQUE POSTALE<br>3,875 % VRN PERP      | 2.400.000                | EUR     | 2.384.873        | 0,33                         |
| WYNN MACAU 5,5 %<br>01/10/2027                                    | 2.128.000                | USD     | 2.038.163        | 0,28                         | LA POSTE 3,125 % VRN PERP                  | 1.300.000                | EUR     | 1.366.896        | 0,19                         |
| ZHENRO PROPERTIES GROUP<br>6,63 % 07.01.26                        | 240.000                  | USD     | 3.271            | 0,00                         | NEXANS 4,25 % 11.03.30                     | 500.000                  | EUR     | 544.498          | 0,08                         |
|   |                          |         | <b>2.109.494</b> | <b>0,29</b>                  | NEXANS 5,5 % 05.04.28                      | 400.000                  | EUR     | 455.596          | 0,06                         |
| <b>KOLUMBIEN</b>  |                          |         |                  |                              | PAPREC HOLDING 7,25 %<br>17.11.29          |                          |         |                  |                              |
| BANCOLOMBIA 4,625 % VRN<br>18.12.29                               | 500.000                  | USD     | 487.940          | 0,07                         | RCI BANQUE 2,625 % VRN<br>18.02.30         | 2.000.000                | EUR     | 2.114.338        | 0,29                         |
| ECOPETROL 4,625 %<br>02/11/2031                                   | 650.000                  | USD     | 541.317          | 0,07                         | RENAULT 2,5 % 02.06.2027                   | 1.200.000                | EUR     | 1.240.672        | 0,17                         |
| ECOPETROL 5,875 %<br>02/11/2051                                   | 500.000                  | USD     | 359.600          | 0,05                         | SPIE 2,625 % 18.06.26                      | 500.000                  | EUR     | 526.096          | 0,07                         |
|   |                          |         | <b>1.388.857</b> | <b>0,19</b>                  | TEREOS FINANCE GROUPE<br>7,25 % 15.04.28   | 636.000                  | EUR     | 727.623          | 0,10                         |
| <b>TSCHECHISCHE REPUBLIK</b>                                      |                          |         |                  |                              | UNIBAILRODAMCOWESTFIELD<br>7,25 % VRN PERP |                          |         |                  |                              |
| ENERGOPRO 11 % 02.11.2028   | 500.000                  | USD     | 546.738          | 0,08                         | VALEO 1 % 03.08.28                         | 800.000                  | EUR     | 754.907          | 0,10                         |
|   |                          |         | <b>546.738</b>   | <b>0,08</b>                  | VALEO 5,875 % 12.04.29                     | 900.000                  | EUR     | 1.038.361        | 0,14                         |
|   |                          |         |                  |                              | VEOLIA ENVIRONNEMENT 2 %<br>VRN PERP       | 900.000                  | EUR     | 879.807          | 0,12                         |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global High Yield Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung                            | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|---|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|
| VEOLIA ENVIRONNEMENT<br>2,5 % VRN PERP                  | 1.400.000                | EUR     | 1.362.393         | 0,19                         | <b>HONGKONG</b>                         |                          |         |                   |                              |
|   |                          |         | <b>29.592.308</b> | <b>4,08</b>                  | FORTUNE STAR 5 %                        |                          |         |                   |                              |
| <b>DEUTSCHLAND</b>                                      |                          |         |                   |                              | 18.05.26                                | 400.000                  | USD     | 344.985           | 0,05                         |
| BAYER 6,625 % VRN                                       |                          |         |                   |                              | MELCO RESORTS FINANCE                   |                          |         |                   |                              |
| 25.09.83  | 2.000.000                | EUR     | 2.154.222         | 0,30                         | 5,75 % 21.07.28                         | 400.000                  | USD     | 378.924           | 0,05                         |
| COMMERZBANK 1,375 % VRN                                 |                          |         |                   |                              | RKPF OVERSEAS 5,125 %                   |                          |         |                   |                              |
| 29.12.31  | 1.800.000                | EUR     | 1.775.656         | 0,24                         | 26.07.26                                | 500.000                  | USD     | 120.805           | 0,02                         |
| COMMERZBANK 4 %   |                          |         |                   |                              | STUDIO CITY FINANCE 5 %                 |                          |         |                   |                              |
| 23.03.26  | 1.400.000                | EUR     | 1.513.438         | 0,21                         | 15.01.29                                | 450.000                  | USD     | 396.650           | 0,05                         |
| COMMERZBANK 4 % VRN                                     |                          |         |                   |                              |   |                          |         | <b>1.241.364</b>  | <b>0,17</b>                  |
| 05/12/2030  | 900.000                  | EUR     | 961.191           | 0,13                         | <b>IRLAND</b>                           |                          |         |                   |                              |
| IHO VERWALTUNGS GMBH                                    |                          |         |                   |                              | BANK OF IRELAND 6,75 %                  |                          |         |                   |                              |
| 3,75 % 15.09.26   | 1.800.000                | EUR     | 1.921.598         | 0,26                         | VRN 01.03.33                            | 900.000                  | EUR     | 1.040.882         | 0,14                         |
| NIDDA HEALTHCARE  |                          |         |                   |                              | ENERGIA GROUP ROI                       |                          |         |                   |                              |
| HOLDING 7,5 % 21.08.2026                                | 1.100.000                | EUR     | 1.227.098         | 0,17                         | FINANCECO 6,875 % 31.07.2028            | 1.000.000                | EUR     | 1.121.345         | 0,16                         |
| SCHAEFFLER 3,375 %                                      |                          |         |                   |                              | VIRGIN MEDIA VENDOR FINANCING           |                          |         |                   |                              |
| 12/10/2028  | 1.000.000                | EUR     | 1.043.943         | 0,14                         | NOTES 5 % 15.07.28                      | 800.000                  | USD     | 734.902           | 0,10                         |
| TUI 5,875 % 15.03.29                                    | 800.000                  | EUR     | 878.748           | 0,12                         |   |                          |         | <b>2.897.129</b>  | <b>0,40</b>                  |
| WEPA HYGIENPRODUKTE                                     |                          |         |                   |                              | <b>ISRAEL</b>                           |                          |         |                   |                              |
| 5,625 % 15.01.31  | 300.000                  | EUR     | 327.668           | 0,05                         | ENERGEAN ISRAEL FINANCE                 |                          |         |                   |                              |
| ZF FINANCE 5,75 %                                       |                          |         |                   |                              | 5,875 % 30.03.31                        | 465.000                  | USD     | 408.519           | 0,06                         |
| 03/08/2026  | 900.000                  | EUR     | 1.001.287         | 0,14                         |   |                          |         | <b>408.519</b>    | <b>0,06</b>                  |
|   |                          |         | <b>12.804.849</b> | <b>1,76</b>                  | <b>ITALIEN</b>                          |                          |         |                   |                              |
| <b>GROSSBRITANNIEN</b>                                  |                          |         |                   |                              | ATLANTIA 1,875 %                        |                          |         |                   |                              |
| BARCLAYS 8 % VRN PERP                                   | 3.767.000                | USD     | 3.767.143         | 0,52                         | 12/02/2028                              | 600.000                  | EUR     | 597.873           | 0,08                         |
| INEOS QUATTRO FINANCE                                   |                          |         |                   |                              | INFRASTRUTTURE WIRELESS                 |                          |         |                   |                              |
| 9,625 % 15.03.29  | 1.583.000                | USD     | 1.705.231         | 0,24                         | 1,625 % 21.10.28                        | 1.067.000                | EUR     | 1.070.500         | 0,15                         |
| INTERNATIONAL GAME TECHNO-<br>LOGY P 2,375 % 15.04.2028 | 500.000                  | EUR     | 509.947           | 0,07                         | INTESA SANPAOLO 6,184 %<br>VRN 20.02.34 | 1.600.000                | EUR     | 1.839.781         | 0,25                         |
| LLOYDS BANKING GROUP                                    |                          |         |                   |                              | MUNDYS 1,875 % 13.07.27                 | 700.000                  | EUR     | 707.206           | 0,10                         |
| 7,5 % VRN PERP  | 3.814.000                | USD     | 3.798.670         | 0,52                         | MUNDYS 4,75 % 24.01.29                  | 1.065.000                | EUR     | 1.173.159         | 0,16                         |
| NGG FINANCE 2,125 % VRN                                 |                          |         |                   |                              | NEXI 2,125 % 30.04.29                   | 400.000                  | EUR     | 388.269           | 0,05                         |
| 05/09/2082  | 1.000.000                | EUR     | 993.488           | 0,14                         | TELECOM ITALIA SPAMILANO                |                          |         |                   |                              |
| ROLLS ROYCE PLC 1,625 %                                 |                          |         |                   |                              | 7,875 % 31.07.28                        | 3.600.000                | EUR     | 4.276.901         | 0,59                         |
| 09/05/2028  | 1.200.000                | EUR     | 1.190.638         | 0,16                         | UNICREDIT 2,731 % VRN                   |                          |         |                   |                              |
| VIRGIN MEDIA FINANCE                                    |                          |         |                   |                              | 15.01.32                                | 1.100.000                | EUR     | 1.129.467         | 0,16                         |
| 3,75 % 15.07.30   | 700.000                  | EUR     | 651.172           | 0,09                         | UNICREDIT 8 % VRN PERP                  | 3.472.000                | USD     | 3.478.576         | 0,48                         |
| VMED FINANCING 5,625 %                                  |                          |         |                   |                              |   |                          |         | <b>14.661.732</b> | <b>2,02</b>                  |
| 15.04.32  | 700.000                  | EUR     | 752.730           | 0,10                         | <b>JERSEY</b>                           |                          |         |                   |                              |
| VODAFONE GROUP 2,625 %<br>VRN 27.08.80                  | 450.000                  | EUR     | 467.195           | 0,06                         | AVIS BUDGET FINANCE 7 %                 |                          |         |                   |                              |
| VODAFONE GROUP 3 % VRN                                  |                          |         |                   |                              | 28.02.29                                | 700.000                  | EUR     | 751.944           | 0,10                         |
| 27.08.80  | 1.200.000                | EUR     | 1.176.016         | 0,16                         | AVIS BUDGET FINANCE                     |                          |         |                   |                              |
| VODAFONE GROUP 4,2 % VRN                                |                          |         |                   |                              | 7,25 % 31.07.30                         | 900.000                  | EUR     | 971.712           | 0,14                         |
| 03/10/2078  | 1.000.000                | EUR     | 1.062.718         | 0,15                         |   |                          |         | <b>1.723.656</b>  | <b>0,24</b>                  |
|   |                          |         | <b>16.074.948</b> | <b>2,21</b>                  | <b>LUXEMBURG</b>                        |                          |         |                   |                              |
| <b>GRIECHENLAND</b>                                     |                          |         |                   |                              | DANA FINANCING                          |                          |         |                   |                              |
| NATIONAL BANK OF GREECE                                 |                          |         |                   |                              | LUXEMBOURG 8,5 % 15.07.31               | 4.300.000                | EUR     | 5.133.774         | 0,70                         |
| 4,5 % VRN 29.01.29                                      | 1.269.000                | EUR     | 1.375.637         | 0,19                         | EPHIOS SUBCO 7,875 %                    |                          |         |                   |                              |
|   |                          |         | <b>1.375.637</b>  | <b>0,19</b>                  | 31.01.31                                | 1.150.000                | EUR     | 1.308.237         | 0,18                         |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global High Yield Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung              | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung                 | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---------------------------|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|------------------------------|--------------------------|---------|------------------|------------------------------|
| LOGICOR FINANCING         |                          |         |                   |                              | <b>PORTUGAL</b>              |                          |         |                  |                              |
| 4,625 % 25.07.28          | 838.000                  | EUR     | 916.598           | 0,13                         | EDP ENERGIAS DE PORTUGAL     |                          |         |                  |                              |
| MHP LUX 6,25 % 19.09.29   | 400.000                  | USD     | 285.819           | 0,04                         | 1,875 % VRN 02.08.81         | 1.000.000                | EUR     | 1.015.851        | 0,14                         |
| MHP LUX 6,95 % 03.04.2026 | 500.000                  | USD     | 423.603           | 0,06                         | EDP ENERGIAS DE PORTUGAL     |                          |         |                  |                              |
| STENA INTERNATIONAL       |                          |         |                   |                              | 5,943 % VRN 23.04.83         | 500.000                  | EUR     | 565.278          | 0,08                         |
| 7,25 % 15.02.28           | 700.000                  | EUR     | 799.482           | 0,11                         |                              |                          |         | <b>1.581.129</b> | <b>0,22</b>                  |
|                           |                          |         | <b>8.867.513</b>  | <b>1,22</b>                  |                              |                          |         |                  |                              |
| <b>MACAU</b>              |                          |         |                   |                              | <b>SPANIEN</b>               |                          |         |                  |                              |
| MGM CHINA HOLDINGS        |                          |         |                   |                              | BANCO DE SABADELL 6 %        |                          |         |                  |                              |
| 4,75 % 01.02.27           | 750.000                  | USD     | 715.540           | 0,10                         | VRN 16.08.33                 | 1.800.000                | EUR     | 2.010.384        | 0,28                         |
| WYNN MACAU 5,625 %        |                          |         |                   |                              | CAIXABANK 6,25 % VRN         |                          |         |                  |                              |
| 26.08.28                  | 1.137.000                | USD     | 1.078.552         | 0,15                         | 23.02.33                     | 600.000                  | EUR     | 687.271          | 0,09                         |
|                           |                          |         | <b>1.794.092</b>  | <b>0,25</b>                  | GRIFOLS 2,25 % 15.11.2027    | 1.450.000                | EUR     | 1.374.019        | 0,19                         |
|                           |                          |         |                   |                              |                              |                          |         | <b>4.071.674</b> | <b>0,56</b>                  |
| <b>MEXIKO</b>             |                          |         |                   |                              | <b>SCHWEDEN</b>              |                          |         |                  |                              |
| BANCO MERCANTIL DEL       |                          |         |                   |                              | VERISURE HOLDING 3,875 %     |                          |         |                  |                              |
| NORTE 6,625 % VRN PERP    | 900.000                  | USD     | 821.084           | 0,11                         | 15.07.26                     | 1.050.000                | EUR     | 1.119.684        | 0,15                         |
| TRUST FIBRA 7,375 %       |                          |         |                   |                              | VERISURE MIDHOLDING          |                          |         |                  |                              |
| 13.02.34                  | 1.000.000                | USD     | 998.784           | 0,14                         | 5,25 % 15.02.29              | 1.474.000                | EUR     | 1.542.479        | 0,22                         |
|                           |                          |         | <b>1.819.868</b>  | <b>0,25</b>                  |                              |                          |         | <b>2.662.163</b> | <b>0,37</b>                  |
| <b>MAROKKO</b>            |                          |         |                   |                              | <b>TÜRKEI</b>                |                          |         |                  |                              |
| OCP 5,125 % 23.06.51      | 700.000                  | USD     | 529.135           | 0,07                         | AKBANK 9,3686 % VRN PERP     | 1.000.000                | USD     | 996.249          | 0,14                         |
|                           |                          |         | <b>529.135</b>    | <b>0,07</b>                  | ISTANBUL METROPOLITAN        |                          |         |                  |                              |
| <b>NIEDERLANDE</b>        |                          |         |                   |                              | MUNICIPALI 10,5 % 06.12.2028 | 467.000                  | USD     | 499.993          | 0,07                         |
| AERCAP HOLDINGS 5,875 %   |                          |         |                   |                              |                              |                          |         | <b>1.496.242</b> | <b>0,21</b>                  |
| VRN 10.10.79              | 705.000                  | USD     | 701.249           | 0,10                         | <b>USA</b>                   |                          |         |                  |                              |
| COOPERATIEVE RABOBANK     |                          |         |                   |                              | ALBERTSONS SAFEWAY           |                          |         |                  |                              |
| 4,875 % VRN PERP          | 600.000                  | EUR     | 611.588           | 0,08                         | 4,875 % 15.02.30             | 1.657.000                | USD     | 1.578.395        | 0,22                         |
| NATURGY FINANCE 2,374 %   |                          |         |                   |                              | ALBERTSONS SAFEWAY 6,5 %     |                          |         |                  |                              |
| VRN PERP                  | 1.500.000                | EUR     | 1.516.907         | 0,21                         | 15.02.28                     | 880.000                  | USD     | 890.768          | 0,12                         |
| NN GROUP 6,375 % VRN PERP | 465.000                  | EUR     | 505.312           | 0,07                         | ARSENAL AIC PARENT           |                          |         |                  |                              |
| OI EUROPEAN GROUP 6,25 %  |                          |         |                   |                              | 8 % 01.10.30                 | 3.294.000                | USD     | 3.474.308        | 0,48                         |
| 15.05.28                  | 700.000                  | EUR     | 790.053           | 0,11                         | EPR PROPERTIES 4,5 %         |                          |         |                  |                              |
| TELEFONICA EUROPE         |                          |         |                   |                              | 01/06/2027                   | 4.454.000                | USD     | 4.247.407        | 0,58                         |
| 2,376 % VRN PERP          | 1.100.000                | EUR     | 1.050.049         | 0,14                         | FORD MOTOR 7,45 %            |                          |         |                  |                              |
| TELEFONICA EUROPE         |                          |         |                   |                              | 16.07.31                     | 2.568.000                | USD     | 2.795.283        | 0,39                         |
| 6,135 % VRN PERP          | 900.000                  | EUR     | 1.009.927         | 0,14                         | GENESIS ENERGY 8,875 %       |                          |         |                  |                              |
| TELEFONICA EUROPE 6,75 %  |                          |         |                   |                              | 15.04.30                     | 1.212.000                | USD     | 1.270.747        | 0,18                         |
| VRN PERP                  | 900.000                  | EUR     | 1.056.153         | 0,15                         | GOODYEAR TIRE RUBBER         |                          |         |                  |                              |
| TENNET HOLDING 2,374 %    |                          |         |                   |                              | 5 % 15.07.29                 | 1.439.000                | USD     | 1.344.070        | 0,19                         |
| VRN PERP                  | 1.700.000                | EUR     | 1.785.945         | 0,25                         | IQVIA 2,25 % 15.01.28        | 1.350.000                | EUR     | 1.357.760        | 0,19                         |
| TRIVIUM PACKAGING         |                          |         |                   |                              | OLYMPUS WATER US             |                          |         |                  |                              |
| FINANCE 5,5 % 15.08.2026  | 3.905.000                | USD     | 3.844.994         | 0,53                         | HOLDING 9,625 % 15.11.28     | 3.000.000                | EUR     | 3.481.273        | 0,47                         |
| ZF EUROPE FINANCE 3 %     |                          |         |                   |                              | ONEMAIN FINANCE 9 %          |                          |         |                  |                              |
| 23.10.29                  | 1.400.000                | EUR     | 1.403.572         | 0,19                         | 15.01.29                     | 2.388.000                | USD     | 2.536.033        | 0,35                         |
| ZF EUROPE FINANCE         |                          |         |                   |                              | PANTHER BF AGGREGATOR        |                          |         |                  |                              |
| 6,125 % 13.03.29          | 400.000                  | EUR     | 459.268           | 0,06                         | 4,375 % 15.05.26             | 2.500.000                | EUR     | 2.688.968        | 0,37                         |
| ZIGGO 2,875 % 15.01.30    | 900.000                  | EUR     | 862.205           | 0,12                         |                              |                          |         |                  |                              |
|                           |                          |         | <b>15.597.222</b> | <b>2,15</b>                  |                              |                          |         |                  |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global High Yield Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--------------------------|---------|--------------------|------------------------------|---|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|
| QUINTILES IMS 2,875 %<br>15.09.25                                | 800.000                  | EUR     | 849.548            | 0,12                         | GFL ENVIRONMENTAL 6,75 %<br>15.01.31                    | 1.939.000                | USD     | 1.991.114         | 0,27                         |
| SASOL FINANCING 4,375 %<br>18.09.26                              | 800.000                  | USD     | 754.532            | 0,10                         | HUSKY INJECTION MOLDING<br>SYSTEMS 9 % 15.02.29         | 1.912.000                | USD     | 1.979.812         | 0,27                         |
| SPRINGLEAF FINANCE<br>5,375 % 15.11.29                           | 2.912.000                | USD     | 2.741.235          | 0,38                         | NOVA CHEMICALS 9 %<br>15.02.30                          | 2.664.000                | USD     | 2.754.203         | 0,38                         |
| UNITED RENTALS NORTH<br>AMERICA 3,75 % 15.01.32                  | 2.744.000                | USD     | 2.397.245          | 0,33                         |   |                          |         | <b>16.526.158</b> | <b>2,27</b>                  |
| US (GOVT) 4,75 %<br>15.11.43                                     | 1.440.000                | USD     | 1.498.163          | 0,21                         | <b>FRANKREICH</b>                                       |                          |         |                   |                              |
| WMG ACQUISITION 2,75 %<br>15.07.28                               | 650.000                  | EUR     | 662.413            | 0,09                         | ALTICE FRANCE 8,125 %<br>01/02/2027                     | 2.170.000                | USD     | 1.679.027         | 0,23                         |
|  |                          |         | <b>34.568.148</b>  | <b>4,77</b>                  | FAURECIA 2,75 % 15.02.2027                              | 1.300.000                | EUR     | 1.345.920         | 0,19                         |
| <b>SUMME ANLEIHEN</b>  |                          |         | <b>171.885.436</b> | <b>23,70</b>                 | GETLINK 3,5 % 30.10.2025                                | 1.000.000                | EUR     | 1.071.991         | 0,15                         |
| <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN</b>                              |                          |         |                    |                              | ILIAD HOLDING SASU 6,5 %<br>15.10.26                    | 3.005.000                | USD     | 2.979.298         | 0,42                         |
| <b>BÖRSE NOTIERTEN WERTPAPIERE</b>                               |                          |         | <b>171.885.436</b> | <b>23,70</b>                 | LOXAM 3,75 % 15.07.26                                   | 400.000                  | EUR     | 428.435           | 0,06                         |
| <b>WERTPAPIERE</b>   |                          |         |                    |                              | LOXAM 5,75 % 15.07.27                                   | 700.000                  | EUR     | 757.426           | 0,10                         |
|  |                          |         |                    |                              | MOBILUX FINANCE 4,25 %<br>15.07.28                      | 1.154.000                | EUR     | 1.173.868         | 0,16                         |
| <b>AN EINEM ANDEREM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE, ÜBERTRAGBARE</b> |                          |         |                    |                              | REXEL 2,125 % 15.06.28                                  | 1.185.000                | EUR     | 1.191.810         | 0,16                         |
| <b>WERTPAPIERE</b>   |                          |         |                    |                              | REXEL 2,125 % 15.12.28                                  | 900.000                  | EUR     | 896.859           | 0,12                         |
|  |                          |         |                    |                              | TEREOS FINANCE GROUPE<br>7,5 % 30.10.25                 | 990.000                  | EUR     | 1.088.740         | 0,15                         |
| <b>ANLEIHEN</b>  |                          |         |                    |                              |   |                          |         | <b>12.613.374</b> | <b>1,74</b>                  |
|  |                          |         |                    |                              | <b>DEUTSCHLAND</b>                                      |                          |         |                   |                              |
| <b>AUSTRALIEN</b>  |                          |         |                    |                              | CECONOMY 1,75 %<br>24.06.26                             | 500.000                  | EUR     | 514.572           | 0,07                         |
| FMG RESOURCES 6,125 %<br>15.04.32                                | 2.691.000                | USD     | 2.664.705          | 0,36                         | COMMERZBANK 4,25 % VRN<br>PERP                          | 800.000                  | EUR     | 751.488           | 0,10                         |
| MINERAL RESOURCES 8 %<br>01/11/2027                              | 1.388.000                | USD     | 1.416.866          | 0,20                         | DEUTSCHE BANK 4 % VRN<br>24.06.32                       | 600.000                  | EUR     | 628.657           | 0,09                         |
| MINERAL RESOURCES<br>8,125 % 01.05.27                            | 2.000.000                | USD     | 2.024.532          | 0,28                         | DEUTSCHE BANK 4,5 % VRN<br>PERP                         | 800.000                  | EUR     | 746.659           | 0,10                         |
|  |                          |         | <b>6.106.103</b>   | <b>0,84</b>                  | DEUTSCHE BANK 4,625 %<br>VRN PERP                       | 1.200.000                | EUR     | 1.105.381         | 0,16                         |
| <b>BRASILIEN</b>   |                          |         |                    |                              |   |                          |         | <b>3.746.757</b>  | <b>0,52</b>                  |
| ITAU UNIBANCO HOLDING<br>4,625 % PERP                            | 750.000                  | USD     | 703.923            | 0,10                         | <b>GROSSBRITANNIEN</b>                                  |                          |         |                   |                              |
| MC BRAZIL DOWNSTREAM<br>TRADING 7,25 % 30.06.2031                | 1.000.000                | USD     | 864.425            | 0,12                         | DRAX FINCO 2,625 %<br>01/11/2025                        | 400.000                  | EUR     | 420.417           | 0,06                         |
| SAMARCO MINERACAO 9,5 %<br>30.06.31                              | 600.000                  | USD     | 542.865            | 0,07                         | EC FINANCE 3 % 15.10.2026                               | 1.500.000                | EUR     | 1.577.277         | 0,22                         |
|  |                          |         | <b>2.111.213</b>   | <b>0,29</b>                  | INTERNATIONAL GAME TECHNO-<br>LOGY 6,25 % 15.01.27      | 2.000.000                | USD     | 2.016.310         | 0,28                         |
| <b>KANADA</b>  |                          |         |                    |                              | LIQUID TELECOMMUNICATIONS<br>FINANCIAL 5,5 % 04.09.2026 | 1.250.000                | USD     | 738.991           | 0,10                         |
| BC ULC NEW RED FINANCE<br>4,375 % 15.01.28                       | 2.665.000                | USD     | 2.521.792          | 0,35                         | MACQUARIE AIRFINANCE<br>HOLDINGS 6,5 % 26.03.31         | 2.422.000                | USD     | 2.468.418         | 0,33                         |
| BOMBARDIER 7,25 %<br>01/07/2031                                  | 312.000                  | USD     | 313.449            | 0,04                         | STANDARD CHARTERED<br>7,875 % VRN PERP                  | 1.000.000                | USD     | 998.610           | 0,14                         |
| FIRST QUANTUM MINERALS<br>6,875 % 15.10.27                       | 1.667.000                | USD     | 1.599.999          | 0,22                         | UPCB FINANCE VII 3,625 %<br>15.06.29                    | 1.400.000                | EUR     | 1.439.024         | 0,20                         |
| FIRST QUANTUM MINERALS 6,875 %<br>15.10.2027 (USC3535CAM04)      | 400.000                  | USD     | 383.923            | 0,05                         | VIRGIN MEDIA FINANCE 5 %<br>15.07.30                    | 2.205.000                | USD     | 1.875.988         | 0,26                         |
| FIRST QUANTUM MINERALS<br>9,375 % 01.03.29                       | 1.741.000                | USD     | 1.805.562          | 0,25                         |   |                          |         | <b>11.535.035</b> | <b>1,59</b>                  |
| GFL ENVIRONMENTAL 4,75 %<br>15.06.29                             | 3.375.000                | USD     | 3.176.304          | 0,44                         |   |                          |         |                   |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global High Yield Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung                                     | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert       | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|--|--------------------------|---------|----------------|------------------------------|
| <b>GUATEMALA</b>                                 |                          |         |                   |                              | <b>MEXIKO</b>  |                          |         |                |                              |
| CT TRUST 5,125 %<br>03/02/2032                   | 800.000                  | USD     | 709.321           | 0,10                         | BRASKEM IDESAPI 6,99 %<br>20.02.32   | 700.000                  | USD     | 544.620        | 0,08                         |
|  |                          |         | <b>709.321</b>    | <b>0,10</b>                  |  |                          |         | <b>544.620</b> | <b>0,08</b>                  |
| <b>IRLAND</b>                                    |                          |         |                   |                              | <b>NIEDERLANDE</b>   |                          |         |                |                              |
| ARDAGH PACKAGING<br>FINANCE 2,125 % 15.08.2026   | 500.000                  | EUR     | 467.084           | 0,06                         | ABERTIS INFRASTRUCTURAS<br>FINANCE 3,248 % VRN PERP<br>ALCOA NEDERLAND HOLDING<br>7,125 % 15.03.31 | 700.000                  | EUR     | 734.172        | 0,10                         |
| ARDAGH PACKAGING<br>FINANCE 5,25 % 15.08.27      | 2.600.000                | USD     | 1.645.756         | 0,23                         | 7,125 % 15.03.31   | 2.019.000                | USD     | 2.058.600      | 0,27                         |
|  |                          |         | <b>2.112.840</b>  | <b>0,29</b>                  | ASHLAND SERVICES 2 %<br>30.01.28   | 700.000                  | EUR     | 695.340        | 0,10                         |
| <b>ISRAEL</b>                                    |                          |         |                   |                              | CONSTELLIUM 4,25 %<br>15.02.26   |                          |         |                |                              |
| LEVIATHAN BOND 6,125 %<br>30.06.25               | 250.000                  | USD     | 246.523           | 0,03                         | DUFYR ONE 2 % 15.02.2027   | 900.000                  | EUR     | 916.882        | 0,13                         |
| LEVIATHAN BOND 6,75 %<br>30.06.30                | 600.000                  | USD     | 558.052           | 0,08                         | GOODYEAR EUROPE 2,75 %<br>15.08.28   | 500.000                  | EUR     | 489.173        | 0,07                         |
|  |                          |         | <b>804.575</b>    | <b>0,11</b>                  | KONINKLIJKE KPN 6 % VRN<br>PERP  |                          |         |                |                              |
| <b>ITALIEN</b>                                   |                          |         |                   |                              | 1.250.000  |                          |         |                |                              |
| NEXI 1,625 % 30.04.26                            | 480.000                  | EUR     | 493.171           | 0,07                         | Q PARK HOLDING 2 %<br>01/03/2027   | 750.000                  | EUR     | 762.783        | 0,11                         |
|  |                          |         | <b>493.171</b>    | <b>0,07</b>                  | TRIVIUM PACKAGING<br>FINANCE 3,75 % 15.08.2026   |                          |         |                |                              |
| <b>JERSEY</b>                                    |                          |         |                   |                              | VZ VENDOR FINANCING<br>2,875 % 15.01.29  |                          |         |                |                              |
| ADIANT GLOBAL HOLDINGS<br>7 % 15.04.28           | 1.106.000                | USD     | 1.132.191         | 0,16                         | ZIGGO BOND 5,125 %<br>28.02.30   | 2.436.000                | USD     | 2.086.719      | 0,28                         |
| ADIANT GLOBAL HOLDINGS<br>8,25 % 15.04.31        | 2.529.000                | USD     | 2.671.793         | 0,36                         | ZIGGO BOND FINANCE 6 %<br>15.01.27   | 1.610.000                | USD     | 1.588.491      | 0,22                         |
|  |                          |         | <b>3.803.984</b>  | <b>0,52</b>                  | <b>15.076.049</b>  |                          |         |                |                              |
| <b>LIBERIA</b>                                   |                          |         |                   |                              | <b>2,08</b>  |                          |         |                |                              |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES<br>6,25 % 15.03.32       | 674.000                  | USD     | 680.309           | 0,09                         | <b>PANAMA</b>  |                          |         |                |                              |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES<br>9,25 % 15.01.29       | 8.694.000                | USD     | 9.330.168         | 1,29                         | CARNIVAL 6 % 01.05.2029  |                          |         |                |                              |
|  |                          |         | <b>10.010.477</b> | <b>1,38</b>                  | 723.000  |                          |         |                |                              |
| <b>LUXEMBURG</b>                                 |                          |         |                   |                              | 714.935  |                          |         |                |                              |
| AEGEA FINANCE 6,75 %<br>20.05.29                 | 614.000                  | USD     | 600.763           | 0,08                         | <b>714.935</b>   |                          |         |                |                              |
| BK LC LUX 5,25 %<br>30.04.29                     | 900.000                  | EUR     | 980.726           | 0,14                         | <b>0,10</b>  |                          |         |                |                              |
| CONTOURGLOBAL POWER<br>HOLDINGS 3,125 % 01.01.28 | 1.200.000                | EUR     | 1.210.167         | 0,16                         | <b>PORTUGAL</b>  |                          |         |                |                              |
| GRAND CITY PROPERTIES<br>1,5 % VRN PERP          | 600.000                  | EUR     | 418.966           | 0,06                         | EDP ENERGIAS DE PORTUGAL<br>1,875 % VRN 14.03.82   |                          |         |                |                              |
| MEXICO REMITTANCES<br>FUNDING 4,875 % 15.01.2028 | 500.000                  | USD     | 358.795           | 0,05                         | 500.000  |                          |         |                |                              |
| TELENET FINANCE LUX<br>NOTE 3,5 % 01.03.28       | 600.000                  | EUR     | 621.183           | 0,09                         | <b>465.827</b>   |                          |         |                |                              |
|  |                          |         | <b>4.190.600</b>  | <b>0,58</b>                  | <b>0,06</b>  |                          |         |                |                              |
| <b>MACAU</b>                                     |                          |         |                   |                              | <b>SPANIEN</b>   |                          |         |                |                              |
| MGM CHINA HOLDINGS<br>5,25 % 18.06.25            | 1.909.000                | USD     | 1.883.120         | 0,26                         | GRIFOLS ESCROW ISSUER<br>4,75 % 15.10.28   |                          |         |                |                              |
|  |                          |         | <b>1.883.120</b>  | <b>0,26</b>                  | 1.993.000  |                          |         |                |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 1.650.537  |                          |         |                |                              |
|  |                          |         |                   |                              | <b>1.650.537</b>   |                          |         |                |                              |
|  |                          |         |                   |                              | <b>0,23</b>  |                          |         |                |                              |
|  |                          |         |                   |                              | <b>SCHWEDEN</b>  |                          |         |                |                              |
|  |                          |         |                   |                              | HEIMSTADEN BOSTAD<br>2,625 % VRN PERP  |                          |         |                |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 500.000  |                          |         |                |                              |
|  |                          |         |                   |                              | HEIMSTADEN BOSTAD 3 %<br>VRN PERP  |                          |         |                |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 615.000  |                          |         |                |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 397.018  |                          |         |                |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 0,05   |                          |         |                |                              |
|  |                          |         |                   |                              | VOLVO CAR 4,25 %<br>31.05.28   |                          |         |                |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 400.000  |                          |         |                |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 435.189  |                          |         |                |                              |
|  |                          |         |                   |                              | <b>1.161.486</b>   |                          |         |                |                              |
|  |                          |         |                   |                              | <b>0,16</b>  |                          |         |                |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global High Yield Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung                                       | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert  | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--------------------------|---------|-----------|------------------------------|---|--------------------------|---------|-----------|------------------------------|
| <b>USA</b>   |                          |         |           |                              | <b>CARNIVAL HOLDINGS BERMUDA</b>                    |                          |         |           |                              |
| AAR ESCROW ISSUER 6,75 %<br>15.03.29               | 1.048.000                | USD     | 1.058.026 | 0,15                         | 10,375 % 01.05.28                                   | 6.271.000                | USD     | 6.847.310 | 0,93                         |
| ADAPTHEALTH 4,625 %<br>01/08/2029                  | 3.045.000                | USD     | 2.622.379 | 0,36                         | CCO HOLDINGS 4,5 %<br>15.08.30                      | 7.116.000                | USD     | 5.990.165 | 0,83                         |
| ALLY FINANCIAL 4,7 % VRN<br>PERP                   | 3.854.000                | USD     | 3.066.446 | 0,42                         | CCO HOLDINGS 5,375 %<br>01/06/2029                  | 2.544.000                | USD     | 2.329.770 | 0,32                         |
| AMER SPORTS 6,75 %<br>16.02.31                     | 1.569.000                | USD     | 1.566.218 | 0,22                         | CCO HOLDINGS 7,375 %<br>01/03/2031                  | 6.000.000                | USD     | 5.888.918 | 0,81                         |
| AMERICAN AIRLINES 8,5 %<br>15.05.29                | 2.514.000                | USD     | 2.657.030 | 0,37                         | CENTRAL PARENT 7,25 %<br>15.06.29                   | 2.598.000                | USD     | 2.655.829 | 0,37                         |
| AMERICAN AIRLINES<br>ADVANTAGE 5,75 %<br>20.04.29  | 5.390.000                | USD     | 5.308.744 | 0,73                         | CHART INDUSTRIES 7,5 %<br>01/01/2030                | 1.874.000                | USD     | 1.947.976 | 0,27                         |
| ANTERO MIDSTREAM<br>PARTNERS 5,375 %<br>15.06.29   | 1.853.000                | USD     | 1.783.296 | 0,25                         | CHART INDUSTRIES 9,5 %<br>01/01/2031                | 1.347.000                | USD     | 1.470.132 | 0,20                         |
| ANTERO MIDSTREAM<br>PARTNERS 6,625 %<br>01/02/2032 | 3.181.000                | USD     | 3.201.491 | 0,44                         | CHSCOMMUNITY HEALTH<br>SYSTEMS 5,25 % 15.05.30      | 931.000                  | USD     | 760.096   | 0,10                         |
| ANTERO RESOURCES 5,375 %<br>01/03/2030             | 5.822.000                | USD     | 5.598.814 | 0,77                         | CHSCOMMUNITY HEALTH<br>SYSTEMS 8 % 15.03.2026       | 2.733.000                | USD     | 2.726.784 | 0,38                         |
| ANTERO RESOURCES 8,375 %<br>15.07.26               | 1.272.000                | USD     | 1.322.809 | 0,18                         | CHURCHILL DOWNS 5,5 %<br>01/04/2027                 | 2.066.000                | USD     | 2.028.902 | 0,28                         |
| ARCHROCK PARTNERS<br>6,875 % 01.04.27              | 6.761.000                | USD     | 6.790.518 | 0,93                         | CINEMARK 5,875 %<br>15.03.26                        | 3.284.000                | USD     | 3.247.501 | 0,45                         |
| ARDAGH PACKAGING<br>FINANCE 4,125 % 15.08.2026     | 3.009.000                | USD     | 2.734.124 | 0,38                         | CIVITAS RESOURCES<br>8,375 % 01.07.28               | 4.017.000                | USD     | 4.242.545 | 0,58                         |
| ARSENAL AIC PARENT<br>11,5 % 01.10.31              | 1.798.000                | USD     | 2.008.446 | 0,28                         | CIVITAS RESOURCES<br>8,625 % 01.11.30               | 565.000                  | USD     | 606.991   | 0,08                         |
| ASCENT RESOURCES UTICA<br>HOLDINGS 8,25 % 31.12.28 | 2.017.000                | USD     | 2.073.654 | 0,29                         | CIVITAS RESOURCES 8,75 %<br>01/07/2031              | 347.000                  | USD     | 372.166   | 0,05                         |
| ASHTON WOODS ASHTON<br>6,625 % 15.01.28            | 2.215.000                | USD     | 2.225.152 | 0,31                         | CLEVELANDCLIFFS 5,875 %<br>01/06/2027               | 2.077.000                | USD     | 2.078.786 | 0,29                         |
| ASHTON WOODS USA 4,625 %<br>01/08/2029             | 2.729.000                | USD     | 2.520.916 | 0,35                         | CLEVELANDCLIFFS 6,75 %<br>15.04.30                  | 2.637.000                | USD     | 2.651.872 | 0,37                         |
| AVIS BUDGET CAR RENTAL<br>8 % 15.02.31             | 2.089.000                | USD     | 2.086.996 | 0,29                         | CLEVELANDCLIFFS 7 %<br>15.03.32                     | 1.434.000                | USD     | 1.454.694 | 0,20                         |
| BLUE RACER MIDSTREAM<br>7,625 % 15.12.25           | 6.540.000                | USD     | 6.608.821 | 0,91                         | CLOUD SOFTWARE 6,5 %<br>31.03.29                    | 3.700.000                | USD     | 3.513.413 | 0,48                         |
| BLUE RACER MIDSTREAM<br>FINANCE 6,625 % 15.07.26   | 2.097.000                | USD     | 2.095.950 | 0,29                         | CLYDESDALE ACQUISITION<br>HOLDINGS 6,625 % 15.04.29 | 1.119.000                | USD     | 1.121.404 | 0,15                         |
| BUCKEYE PARTNERS 5,85 %<br>15.11.43                | 5.425.000                | USD     | 4.614.027 | 0,64                         | CLYDESDALE ACQUISITION<br>HOLDINGS 8,75 % 15.04.30  | 2.845.000                | USD     | 2.799.241 | 0,39                         |
| BUILDERS FIRSTSOURCE<br>6,375 % 01.03.34           | 4.218.000                | USD     | 4.236.644 | 0,58                         | COLGATE ENERGY PARTNERS<br>5,875 % 01.07.29         | 2.667.000                | USD     | 2.624.849 | 0,36                         |
| CAESARS ENTERTAINMENT<br>6,5 % 15.02.32            | 717.000                  | USD     | 724.463   | 0,10                         | COLT MERGER 8,125 %<br>01/07/2027                   | 4.846.000                | USD     | 4.968.668 | 0,68                         |
| CALPINE 5,125 % 15.03.2028                         | 9.051.000                | USD     | 8.698.792 | 1,19                         | CORNERSTONE BUILDING<br>BRANDS 6,125 % 15.01.29     | 1.713.000                | USD     | 1.534.130 | 0,21                         |
| CAMELOT RETURN MERGER<br>8,75 % 01.08.28           | 3.028.000                | USD     | 3.111.021 | 0,43                         | CSC HOLDINGS 11,25 %<br>15.05.28                    | 4.273.000                | USD     | 4.239.578 | 0,58                         |
|  |                          |         |           |                              | DAVE BUSTERS 7,625 %<br>01/11/2025                  | 4.598.000                | USD     | 4.636.750 | 0,64                         |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global High Yield Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert  | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung                                      | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--------------------------|---------|-----------|------------------------------|---|--------------------------|---------|-----------|------------------------------|
| DIRECTV HOLDINGS 5,875 %<br>15.08.27                   | 1.000.000                | USD     | 946.958   | 0,13                         | KINETIK HOLDINGS 5,875 %<br>15.06.30              | 6.952.000                | USD     | 6.807.426 | 0,93                         |
| DISH NETWORK 11,75 %<br>15.11.27                       | 2.213.000                | USD     | 2.262.301 | 0,31                         | KODIAK GAS SERVICES<br>7,25 % 15.02.29            | 647.000                  | USD     | 659.904   | 0,09                         |
| EMERALD DEBT MERGER<br>6,625 % 15.12.30                | 2.132.000                | USD     | 2.156.755 | 0,30                         | KOSMOS ENERGY 7,75 %<br>01/05/2027                | 700.000                  | USD     | 691.959   | 0,10                         |
| EQM MIDSTREAM PARTNERS<br>7,5 % 01.06.27               | 3.030.000                | USD     | 3.115.641 | 0,43                         | LABL 9,5 % 01.11.28                               | 4.627.000                | USD     | 4.691.424 | 0,65                         |
| EQM MIDSTREAM PARTNERS<br>7,5 % 01.06.30               | 2.453.000                | USD     | 2.625.806 | 0,36                         | LEVEL 3 FINANCING 10,5 %<br>15.05.30              | 2.528.000                | USD     | 2.613.144 | 0,36                         |
| ESAB 6,25 % 15.04.29                                   | 894.000                  | USD     | 899.464   | 0,12                         | LEVI STRAUSS 3,375 %<br>15.03.27                  | 1.000.000                | EUR     | 1.064.617 | 0,15                         |
| FERTITTA ENTERTAINMENT<br>6,75 % 15.07.30              | 1.557.000                | USD     | 1.403.324 | 0,19                         | LIFEPOINT HEALTH 9,875 %<br>15.08.30              | 3.256.000                | USD     | 3.409.067 | 0,47                         |
| FORTREA HOLDINGS 7,5 %<br>01/07/2030                   | 2.289.000                | USD     | 2.366.725 | 0,33                         | MACYS RETAIL HOLDINGS<br>5,875 % 01.04.29         | 4.304.000                | USD     | 4.227.237 | 0,58                         |
| FREEDOM MORTGAGE<br>HOLDINGS 9,25 % 01.02.29           | 1.004.000                | USD     | 1.028.568 | 0,14                         | MCAFFEE 7,375 % 15.02.30                          | 2.975.000                | USD     | 2.747.197 | 0,38                         |
| FRONTIER COMMUNICATIONS<br>5,875 % 15.10.27            | 3.415.000                | USD     | 3.310.203 | 0,46                         | MEDLINE BORROWER<br>LP MEDLINE 6,25 % 01.04.2029  | 1.823.000                | USD     | 1.833.452 | 0,25                         |
| GEN DIGITAL 7,125 %<br>30.09.30                        | 2.611.000                | USD     | 2.684.346 | 0,37                         | MGM RESORTS INTERNATIONAL<br>6,5 % 15.04.32       | 2.496.000                | USD     | 2.493.672 | 0,34                         |
| GENESIS ENERGY<br>7,75 % 01.02.28                      | 2.649.000                | USD     | 2.666.465 | 0,37                         | MODIVCARE ESCROW ISSUER<br>5 % 01.10.29           | 2.962.000                | USD     | 2.151.208 | 0,30                         |
| GLP CAPITAL LP GLP FINANCING<br>6,75 % 01.12.33        | 1.250.000                | USD     | 1.318.624 | 0,18                         | MOZART DEBT MERGER<br>3,875 % 01.04.29            | 3.056.000                | USD     | 2.786.638 | 0,38                         |
| GPC MERGER 7,125 %<br>15.08.28                         | 4.037.000                | USD     | 3.666.956 | 0,51                         | MPT OPERATING PARTNERSHIP<br>3,325 % 24.03.25     | 2.900.000                | EUR     | 2.956.891 | 0,41                         |
| GRAY ESCROW 7 %<br>15.05.27                            | 2.646.000                | USD     | 2.465.525 | 0,34                         | MSCI 3,875 % 15.02.31                             | 2.479.000                | USD     | 2.215.634 | 0,31                         |
| HERC HOLDINGS 5,5 %<br>15.07.27                        | 1.252.000                | USD     | 1.231.956 | 0,17                         | NATIONSTAR MORTGAGE<br>HOLDINGS 5,75 % 15.11.31   | 7.657.000                | USD     | 7.070.167 | 0,96                         |
| HILTON GRAND VACATIONS<br>BORROWER 6,625 %<br>15.01.32 | 2.086.000                | USD     | 2.093.977 | 0,29                         | NATIONSTAR MORTGAGE<br>HOLDINGS 7,125 % 01.02.32  | 698.000                  | USD     | 694.833   | 0,10                         |
| HOME POINT CAPITAL 5 %<br>01/02/2026                   | 3.833.000                | USD     | 3.755.440 | 0,52                         | NAVIENT 6,75 % 15.06.2026                         | 5.424.000                | USD     | 5.477.914 | 0,76                         |
| IQVIA 2,875 % 15.06.28                                 | 6.000.000                | EUR     | 6.111.658 | 0,84                         | NCL 8,125 % 15.01.29                              | 3.363.000                | USD     | 3.567.061 | 0,49                         |
| IQVIA 6,5 % 15.05.30                                   | 2.142.000                | USD     | 2.188.029 | 0,30                         | NCR 5,125 % 15.04.29                              | 1.387.000                | USD     | 1.287.636 | 0,18                         |
| IRON MOUNTAIN 5,25 %<br>15.03.28                       | 3.711.000                | USD     | 3.595.246 | 0,50                         | NCR ATLEOS ESCROW 9,5 %<br>01/04/2029             | 3.042.000                | USD     | 3.255.718 | 0,45                         |
| IRON MOUNTAIN 5,25 %<br>15.07.30                       | 4.341.000                | USD     | 4.117.380 | 0,57                         | NOVELIS 4,75 % 30.01.2030                         | 1.654.000                | USD     | 1.530.706 | 0,21                         |
| JEFFERIES FINANCE 5 %<br>15.08.28                      | 2.752.000                | USD     | 2.534.428 | 0,35                         | OPEN TEXT HOLDINGS<br>4,125 % 01.12.31            | 1.619.000                | USD     | 1.421.021 | 0,20                         |
| JELD WEN 4,875 %<br>15.12.27                           | 3.841.000                | USD     | 3.684.588 | 0,51                         | OWENS MINOR 6,625 %<br>01/04/2030                 | 2.144.000                | USD     | 2.130.377 | 0,29                         |
| KAISER ALUMINUM 4,625 %<br>01/03/2028                  | 3.070.000                | USD     | 2.888.441 | 0,40                         | PACTIV EVERGREEN GROUP<br>ISSUER 4,375 % 15.10.28 | 767.000                  | USD     | 716.759   | 0,10                         |
|  |                          |         |           |                              | PANTHER BF AGGREGATOR<br>8,5 % 15.05.27           | 5.554.000                | USD     | 5.565.564 | 0,77                         |
|  |                          |         |           |                              | PENNYMAC FINANCIAL<br>SERVICES 5,75 % 15.09.31    | 6.386.000                | USD     | 5.938.130 | 0,82                         |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global High Yield Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung                                     | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert  | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--------------------------|---------|-----------|------------------------------|---|--------------------------|---------|--------------------|------------------------------|
| PENNYMAC FINANCIAL SERVICES 7,875 % 15.12.29     | 1.355.000                | USD     | 1.393.948 | 0,19                         | TRANSDIGM 7,125 % 01/12/2031  | 810.000                  | USD     | 836.089            | 0,12                         |
| PERMIAN RESOURCES OPERATING 7 % 15.01.32         | 5.000.000                | USD     | 5.187.044 | 0,72                         | TRONOX 4,625 % 15.03.29   | 3.852.000                | USD     | 3.461.870          | 0,48                         |
| PETSMART FINANCE 7,75 % 15.02.29                 | 4.048.000                | USD     | 3.946.210 | 0,54                         | UBER TECHNOLOGIES 8 % 01/11/2026  | 930.000                  | USD     | 941.935            | 0,13                         |
| POST HOLDINGS 4,625 % 15.04.30                   | 4.322.000                | USD     | 3.977.082 | 0,55                         | UNITED AIRLINES 4,625 % 15.04.29  | 3.000.000                | USD     | 2.794.243          | 0,39                         |
| PRAIRIE ACQUIROR 9 % 01/08/2029                  | 1.262.000                | USD     | 1.303.512 | 0,18                         | VENTURE GLOBAL 8,125 % 01/06/2028   | 7.334.000                | USD     | 7.497.949          | 1,02                         |
| PRESIDIO HOLDINGS 8,25 % 01/02/2028              | 3.076.000                | USD     | 3.074.149 | 0,42                         | VENTURE GLOBAL 9,875 % 01/02/2032   | 572.000                  | USD     | 617.392            | 0,09                         |
| PRIME SECURITY SERVICES BORROWER 6,25 % 15.01.28 | 4.571.000                | USD     | 4.483.526 | 0,62                         | VICI PROPERTIES 4,125 % 15.08.30  | 2.000.000                | USD     | 1.824.669          | 0,25                         |
| RITHM CAPITAL 6,25 % 15.10.25                    | 1.906.000                | USD     | 1.893.555 | 0,26                         | VIKING CRUISES 9,125 % 15.07.31   | 1.897.000                | USD     | 2.078.163          | 0,29                         |
| RITHM CAPITAL 8 % 01/04/2029                     | 3.031.000                | USD     | 2.942.736 | 0,41                         | VIKING OCEAN CRUISES 5,625 % 15.02.29   | 4.184.000                | USD     | 4.081.939          | 0,56                         |
| SEAGATE 8,25 % 15.12.29                          | 2.870.000                | USD     | 3.089.946 | 0,43                         | VINE ENERGY HOLDINGS 6,75 % 15.04.29  | 5.403.000                | USD     | 5.467.750          | 0,75                         |
| SERVICE PROPERTIES TRUST 7,5 % 15.09.25          | 3.726.000                | USD     | 3.776.687 | 0,52                         | VISTRA 7 % VRN PERP   | 2.663.000                | USD     | 2.639.508          | 0,36                         |
| SERVICE PROPERTIES TRUST 8,625 % 15.11.31        | 2.073.000                | USD     | 2.213.114 | 0,31                         | VISTRA 8 % VRN PERP   | 1.622.000                | USD     | 1.656.392          | 0,23                         |
| SIERRACOL ENERGY ANDINA 6 % 15.06.28             | 443.000                  | USD     | 389.700   | 0,05                         | VISTRA OPERATIONS 5,5 % 01/09/2026  | 1.727.000                | USD     | 1.702.297          | 0,23                         |
| SIRIUS XM RADIO 5 % 01/08/2027                   | 3.103.000                | USD     | 2.992.189 | 0,41                         | WAND NEWCO 7,625 % 30.01.32   | 1.952.000                | USD     | 2.021.789          | 0,28                         |
| STANDARD INDUSTRIES 4,75 % 15.01.28              | 3.542.000                | USD     | 3.385.436 | 0,47                         | WASH MULTIFAMILY ACQUISITION 5,75 % 15.04.26                                    | 2.631.000                | USD     | 2.576.692          | 0,36                         |
| SUMMIT MATERIALS 7,25 % 15.01.31                 | 632.000                  | USD     | 657.431   | 0,09                         | WR GRACE HOLDINGS 5,625 % 15.08.29  | 3.079.000                | USD     | 2.759.268          | 0,38                         |
| SUNOCO LP SUNOCO FINANCE 7 % 15.09.28            | 2.028.000                | USD     | 2.074.977 | 0,29                         | WR GRACE HOLDINGS 7,375 % 01.03.31  | 1.637.000                | USD     | 1.662.870          | 0,23                         |
| SURGERY CENTER HOLDINGS 7,25 % 15.04.32          | 1.819.000                | USD     | 1.831.647 | 0,25                         | WYNDHAM DESTINATIONS 6,625 % 31.07.26   | 3.000.000                | USD     | 3.024.616          | 0,42                         |
| TALLGRASS ENERGY PARTNERS 6 % 01.03.2027         | 4.268.000                | USD     | 4.204.908 | 0,58                         | <b>411.545.417</b>  |                          |         | <b>56,73</b>       |                              |
| TALLGRASS ENERGY PARTNERS 7,375 % 15.02.29       | 2.546.000                | USD     | 2.562.447 | 0,35                         | <b>SUMME ANLEIHEN</b>   |                          |         | <b>507.805.599</b> | <b>70,00</b>                 |
| TENET HEALTHCARE 5,125 % 01/11/2027              | 1.500.000                | USD     | 1.468.256 | 0,20                         | <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN MARKT GEHANDELTEN ÜBERTRAGBAREN WERTPAPIERE</b> |                          |         | <b>507.805.599</b> | <b>70,00</b>                 |
| TENET HEALTHCARE 6,125 % 01/10/2028              | 5.310.000                | USD     | 5.300.661 | 0,73                         | <b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>  |                          |         |                    |                              |
| TRANSDIGM 5,5 % 15.11.2027                       | 2.152.000                | USD     | 2.109.383 | 0,29                         | <b>IRLAND</b>   |                          |         |                    |                              |
| TRANSDIGM 6,75 % 15.08.28                        | 3.016.000                | USD     | 3.064.035 | 0,42                         | HSBC GLOBAL LIQUIDITY FUND  | 6.013.437                | USD     | 6.013.437          | 0,83                         |
|  |                          |         |           |                              | ISHARES EURO HIGH YIELD CORP UCITS BOND ETF                                     | 15.500                   | EUR     | 1.534.841          | 0,21                         |
|  |                          |         |           |                              | <b>7.548.278</b>  |                          |         | <b>1,04</b>        |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global High Yield Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung                                   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--------------------------|---------|--------------------|------------------------------|
| <b>LUXEMBURG</b>                               |                          |         |                    |                              |
| HGIF GLOBAL ASSET<br>BACKED HIGH YIELD „ZC“    | 113.252                  | USD     | 27.275.002         | 3,76                         |
|  |                          |         | <b>27.275.002</b>  | <b>3,76</b>                  |
| <b>SUMME ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b> |                          |         | <b>34.823.280</b>  | <b>4,80</b>                  |
| <b>SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>       |                          |         |                    |                              |
| <b>ANLEIHEN</b>                                |                          |         |                    |                              |
| <b>NIEDERLANDE</b>                             |                          |         |                    |                              |
| IHS NETHERLANDS HOLDCO<br>8 % 18.09.27         | 1.000.000                | USD     | 957.766            | 0,13                         |
|  |                          |         | <b>957.766</b>     | <b>0,13</b>                  |
| <b>SUMME ANLEIHEN</b>                          |                          |         | <b>957.766</b>     | <b>0,13</b>                  |
| <b>SUMME SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |                          |         | <b>957.766</b>     | <b>0,13</b>                  |
| <b>SUMME WERTPAPIERANLAGEN</b>                 |                          |         | <b>715.472.081</b> | <b>98,63</b>                 |
| <b>SONSTIGES NETTOVERMÖGEN</b>                 |                          |         | <b>9.912.141</b>   | <b>1,37</b>                  |
| <b>GESAMTNETTOVERMÖGEN</b>                     |                          |         | <b>725.384.222</b> | <b>100,00</b>                |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global High Yield ESG Bond

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung                                   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|----------|------------------------------|--|--------------------------|---------|----------|------------------------------|
| <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>  |                          |         |          |                              | VEOLIA ENVIRONNEMENT<br>2,25 % VRN PERP        |                          |         |          |                              |
| <b>AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE<br/>WERTPAPIERE</b> |                          |         |          |                              | 100.000  | EUR                      | 103.080 | 0,30     |                              |
| <b>ANLEIHEN</b>   |                          |         |          |                              | VEOLIA ENVIRONNEMENT<br>2,5 % VRN PERP         |                          |         |          |                              |
| <b>ÖSTERREICH</b>   |                          |         |          |                              | 100.000  | EUR                      | 97.296  | 0,28     |                              |
| ERSTE GROUP BANK 4,25 %<br>VRN PERP                                   |                          |         |          |                              |  |                          |         |          | <b>2.158.564</b>             |
| <b>BELGIEN</b>  |                          |         |          |                              |  |                          |         |          | <b>6,23</b>                  |
| KBC GROUP 4,25 % VRN PERP   |                          |         |          |                              |  |                          |         |          |                              |
| <b>KANADA</b>   |                          |         |          |                              | <b>DEUTSCHLAND</b>                             |                          |         |          |                              |
| NOVA CHEMICALS 8,5 %<br>15.11.28                                      |                          |         |          |                              | COMMERZBANK 1,375 % VRN<br>29.12.31            |                          |         |          |                              |
| 15.11.28  |                          |         |          |                              | 100.000  | EUR                      | 98.629  | 0,28     |                              |
| <b>DÄNEMARK</b>   |                          |         |          |                              | COMMERZBANK 4 % VRN<br>05/12/2030              |                          |         |          |                              |
| ORSTED 5,125 % VRN<br>14.03.24  |                          |         |          |                              | 100.000  | EUR                      | 106.779 | 0,31     |                              |
| <b>FINNLAND</b>   |                          |         |          |                              | 100.000  | EUR                      | 109.823 | 0,32     |                              |
| HUHTAMAKI 4,25 %<br>09/06/2027  |                          |         |          |                              |  |                          |         |          | <b>315.231</b>               |
| <b>FRANKREICH</b>   |                          |         |          |                              |  |                          |         |          | <b>0,91</b>                  |
| BNP PARIBAS 7,375 % VRN<br>PERP                                       |                          |         |          |                              | <b>GROSSBRITANNIEN</b>                         |                          |         |          |                              |
| CROWN EUROPEAN HOLDINGS<br>5 % 15.05.28                               |                          |         |          |                              | BARCLAYS 8 % VRN PERP                          |                          |         |          |                              |
| ELECTRICITE DE FRANCE<br>2,875 % VRN PERP                             |                          |         |          |                              | 200.000  | USD                      | 200.008 | 0,58     |                              |
| ELECTRICITE DE FRANCE<br>4 % VRN PERP                                 |                          |         |          |                              | LLOYDS BANKING GROUP<br>7,5 % VRN PERP         |                          |         |          |                              |
| ELIS 4,125 % 24.05.27   |                          |         |          |                              | 200.000  | USD                      | 199.196 | 0,57     |                              |
| FAURECIA 2,375 %<br>15.06.27  |                          |         |          |                              | NGG FINANCE 2,125 % VRN<br>05/09/2082          |                          |         |          |                              |
| FAURECIA 2,375 %<br>15.06.29  |                          |         |          |                              | 100.000  | EUR                      | 99.330  | 0,29     |                              |
| GOLDSTORY 6,75 %<br>01/02/2030  |                          |         |          |                              | VODAFONE GROUP 2,625 %<br>VRN 27.08.80         |                          |         |          |                              |
| LA BANQUE POSTALE 5,5 %<br>VRN 05.03.34                               |                          |         |          |                              | 200.000  | EUR                      | 207.604 | 0,60     |                              |
| LA POSTE 3,125 % VRN PERP   |                          |         |          |                              |  |                          |         |          | <b>706.138</b>               |
| NEXANS 5,5 % 05.04.28   |                          |         |          |                              |  |                          |         |          | <b>2,04</b>                  |
| PAPREC HOLDING 7,25 %<br>17.11.29                                     |                          |         |          |                              | <b>IRLAND</b>                                  |                          |         |          |                              |
| RCI BANQUE 2,625 % VRN<br>18.02.30                                    |                          |         |          |                              | BANK OF IRELAND 6,75 %<br>VRN 01.03.33         |                          |         |          |                              |
| VALEO 5,875 % 12.04.29  |                          |         |          |                              | 100.000  | EUR                      | 115.632 | 0,34     |                              |
|   |                          |         |          |                              | ENERGIA GROUP ROI                              |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |          |                              | 100.000  | EUR                      | 112.114 | 0,32     |                              |
|   |                          |         |          |                              | FINANCECO 6,875 % 31.07.2028                   |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |          |                              |  |                          |         |          | <b>227.746</b>               |
|   |                          |         |          |                              |  |                          |         |          | <b>0,66</b>                  |
|   |                          |         |          |                              | <b>ITALIEN</b>                                 |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |          |                              | INFRASTRUTTURE WIRELESS<br>1,625 % 21.10.28    |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |          |                              | 100.000  | EUR                      | 100.309 | 0,29     |                              |
|   |                          |         |          |                              | INTESA SANPAOLO 6,184 %<br>VRN 20.02.34        |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |          |                              | 200.000  | EUR                      | 229.930 | 0,66     |                              |
|   |                          |         |          |                              | TELECOM ITALIA<br>SPAMILANO 7,875 % 31.07.2028 |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |          |                              | 200.000  | EUR                      | 237.562 | 0,69     |                              |
|   |                          |         |          |                              |  |                          |         |          | <b>567.801</b>               |
|   |                          |         |          |                              |  |                          |         |          | <b>1,64</b>                  |
|   |                          |         |          |                              | <b>JERSEY</b>                                  |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |          |                              | AVIS BUDGET FINANCE<br>7,25 % 31.07.30         |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |          |                              | 100.000  | EUR                      | 107.948 | 0,31     |                              |
|   |                          |         |          |                              |  |                          |         |          | <b>107.948</b>               |
|   |                          |         |          |                              |  |                          |         |          | <b>0,31</b>                  |
|   |                          |         |          |                              | <b>LUXEMBURG</b>                               |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |          |                              | EPHIOS SUBCO 7,875 %<br>31.01.31               |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |          |                              | 100.000  | EUR                      | 113.739 | 0,33     |                              |
|   |                          |         |          |                              | STENA INTERNATIONAL<br>7,25 % 15.02.28         |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |          |                              | 100.000  | EUR                      | 114.190 | 0,33     |                              |
|   |                          |         |          |                              |  |                          |         |          | <b>227.929</b>               |
|   |                          |         |          |                              |  |                          |         |          | <b>0,66</b>                  |
|   |                          |         |          |                              | <b>NIEDERLANDE</b>                             |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |          |                              | AERCAP HOLDINGS 5,875 %<br>VRN 10.10.79        |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |          |                              | 332.000  | USD                      | 330.234 | 0,95     |                              |
|   |                          |         |          |                              | GAS NATURAL FENOSA<br>FINANCE 3,375 % VRN PERP |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |          |                              | 100.000  | EUR                      | 108.037 | 0,31     |                              |
|   |                          |         |          |                              | NATURGY FINANCE 2,374 %<br>VRN PERP            |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |          |                              | 100.000  | EUR                      | 101.108 | 0,29     |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global High Yield ESG Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung                                     | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--------------------------|---------|------------------|------------------------------|---|--------------------------|---------|------------------|------------------------------|
| TELEFONICA EUROPE<br>6,135 % VRN PERP            | 100.000                  | EUR     | 112.193          | 0,32                         | AMERICA 3,75 % 15.01.32   | 97.000                   | USD     | 84.742           | 0,24                         |
| TELEFONICA EUROPE VRN<br>PERP                    | 100.000                  | EUR     | 105.981          | 0,31                         | US (GOVT) 4,75 %<br>15.11.43  | 62.000                   | USD     | 64.504           | 0,19                         |
| TENNET HOLDING 2,374 %<br>VRN PERP               | 100.000                  | EUR     | 105.036          | 0,30                         |   |                          |         | <b>874.170</b>   | <b>2,52</b>                  |
| TRIVIUM PACKAGING<br>FINANCE 5,5 % 15.08.2026    | 463.000                  | USD     | 455.885          | 1,32                         | <b>SUMME ANLEIHEN</b>   |                          |         | <b>7.993.541</b> | <b>23,06</b>                 |
|  |                          |         | <b>1.318.474</b> | <b>3,80</b>                  | <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN<br/>BÖRSE NOTIERTEN WERTPAPIERE<br/>WERTPAPIERE</b> |                          |         | <b>7.993.541</b> | <b>23,06</b>                 |
| <b>PORTUGAL</b>                                  |                          |         |                  |                              | <b>AN EINEM ANDEREM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE, ÜBERTRAGBARE<br/>WERTPAPIERE</b>    |                          |         |                  |                              |
| EDP ENERGIAS DE PORTUGAL<br>5,943 % VRN 23.04.83 | 100.000                  | EUR     | 113.035          | 0,33                         | <b>ANLEIHEN</b>   |                          |         |                  |                              |
| EDP ENERGIAS DE PORTUGAL<br>1,875 % VRN 02.08.81 | 100.000                  | EUR     | 101.566          | 0,29                         | <b>AUSTRALIEN</b>   |                          |         |                  |                              |
|  |                          |         | <b>214.601</b>   | <b>0,62</b>                  | FMG RESOURCES 5,875 %<br>15.04.30   | 220.000                  | USD     | 216.469          | 0,62                         |
| <b>SPANIEN</b>                                   |                          |         |                  |                              | MINERAL RESOURCES 8 %<br>01/11/2027   | 47.000                   | USD     | 47.977           | 0,14                         |
| BANCO DE SABADELL 6 %<br>VRN 16.08.33            | 100.000                  | EUR     | 111.667          | 0,32                         | MINERAL RESOURCES<br>8,125 % 01.05.27   | 117.000                  | USD     | 118.435          | 0,34                         |
| CAIXABANK 1,25 % VRN<br>18.06.31                 | 100.000                  | EUR     | 101.238          | 0,29                         | MINERAL RESOURCES 8,5 %<br>01/05/2030   | 41.000                   | USD     | 42.331           | 0,12                         |
| CELLNEX TELECOM 1,75 %<br>23.10.30               | 100.000                  | EUR     | 96.361           | 0,28                         |   |                          |         | <b>425.212</b>   | <b>1,22</b>                  |
| CELLNEX TELECOM 1,875 %<br>26.06.29              | 100.000                  | EUR     | 99.204           | 0,29                         | <b>KANADA</b>   |                          |         |                  |                              |
| GRIFOLS 2,25 % 15.11.2027                        | 100.000                  | EUR     | 94.742           | 0,27                         | BC ULC NEW RED  |                          |         |                  |                              |
|  |                          |         | <b>503.212</b>   | <b>1,45</b>                  | FINANCE 4,375 % 15.01.28  | 398.000                  | USD     | 376.612          | 1,08                         |
| <b>SCHWEDEN</b>                                  |                          |         |                  |                              | HUSKY INJECTION MOLDING<br>SYSTEMS 9 % 15.02.29                                     | 66.000                   | USD     | 68.341           | 0,20                         |
| VERISURE MIDHOLDING<br>5,25 % 15.02.29           | 100.000                  | EUR     | 104.626          | 0,30                         | NOVA CHEMICALS 9 %<br>15.02.30  | 103.000                  | USD     | 106.488          | 0,31                         |
|  |                          |         | <b>104.626</b>   | <b>0,30</b>                  | OPEN TEXT 6,9 % 01.12.2027  | 344.000                  | USD     | 356.183          | 1,03                         |
| <b>USA</b>                                       |                          |         |                  |                              |   |                          |         | <b>907.624</b>   | <b>2,62</b>                  |
| ALBERTSONS SAFEWAY<br>4,875 % 15.02.30           | 58.000                   | USD     | 55.249           | 0,16                         | <b>FRANKREICH</b>   |                          |         |                  |                              |
| ALBERTSONS SAFEWAY 6,5 %<br>15.02.28             | 95.000                   | USD     | 96.162           | 0,28                         | CONSTELLIUM 5,625 %<br>15.06.28   | 487.000                  | USD     | 474.760          | 1,37                         |
| ARSENAL AIC PARENT<br>8 % 01.10.30               | 136.000                  | USD     | 143.445          | 0,41                         | FNAC DARTY 2,625 %<br>30.05.26  | 100.000                  | EUR     | 107.525          | 0,31                         |
| BALL CORP 6,875 %<br>15.03.28                    | 23.000                   | USD     | 23.657           | 0,07                         | GETLINK 3,5 % 30.10.2025  | 100.000                  | EUR     | 107.179          | 0,31                         |
| GOODYEAR TIRE RUBBER<br>5 % 15.07.29             | 113.000                  | USD     | 105.545          | 0,30                         | MOBILUX FINANCE 4,25 %<br>15.07.28  | 100.000                  | EUR     | 101.703          | 0,29                         |
| IQVIA 2,25 % 15.01.28                            | 100.000                  | EUR     | 100.556          | 0,29                         | REXEL 2,125 % 15.06.28  | 200.000                  | EUR     | 201.112          | 0,58                         |
| QUINTILES IMS 2,875 %<br>15.09.25                | 100.000                  | EUR     | 106.174          | 0,31                         |   |                          |         | <b>992.279</b>   | <b>2,86</b>                  |
| SPRINGLEAF FINANCE<br>5,375 % 15.11.29           | 100.000                  | USD     | 94.136           | 0,27                         | <b>DEUTSCHLAND</b>  |                          |         |                  |                              |
| UNITED RENTALS NORTH                             |                          |         |                  |                              | DEUTSCHE BANK 4,5 % VRN<br>PERP   | 200.000                  | EUR     | 186.630          | 0,54                         |
|  |                          |         |                  |                              |   |                          |         | <b>186.630</b>   | <b>0,54</b>                  |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global High Yield ESG Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung              | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert       | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung                | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert       | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---------------------------|--------------------------|---------|----------------|------------------------------|-----------------------------|--------------------------|---------|----------------|------------------------------|
| <b>GROSSBRITANNIEN</b>    |                          |         |                |                              | <b>SCHWEDEN</b>             |                          |         |                |                              |
| DRAX FINCO 2,625 %        |                          |         |                |                              | HEIMSTADEN BOSTAD 3 %       |                          |         |                |                              |
| 01/11/2025                | 100.000                  | EUR     | 105.085        | 0,30                         | VRN PERP                    | 100.000                  | EUR     | 64.544         | 0,19                         |
| EC FINANCE 3 % 15.10.2026 | 100.000                  | EUR     | 105.132        | 0,31                         | VOLVO CAR 4,25 %            |                          |         |                |                              |
| NOMAD FOODS BONDCO 2,5 %  |                          |         |                |                              | 31.05.28                    | 100.000                  | EUR     | 108.777        | 0,31                         |
| 24.06.28                  | 100.000                  | EUR     | 101.035        | 0,29                         |                             |                          |         | <b>173.321</b> | <b>0,50</b>                  |
|                           |                          |         | <b>311.252</b> | <b>0,90</b>                  | <b>USA</b>                  |                          |         |                |                              |
| <b>ITALIEN</b>            |                          |         |                |                              | AAR ESCROW ISSUER 6,75 %    |                          |         |                |                              |
| NEXI 1,625 % 30.04.26     | 100.000                  | EUR     | 102.725        | 0,30                         | 15.03.29                    | 35.000                   | USD     | 35.335         | 0,10                         |
|                           |                          |         | <b>102.725</b> | <b>0,30</b>                  | ADAPTHEALTH 5,125 %         |                          |         |                |                              |
| <b>JERSEY</b>             |                          |         |                |                              | 01/03/2030                  | 145.000                  | USD     | 126.562        | 0,37                         |
| ADIANT GLOBAL HOLDINGS    |                          |         |                |                              | ALLY FINANCIAL 4,7 % VRN    |                          |         |                |                              |
| 7 % 15.04.28              | 39.000                   | USD     | 39.924         | 0,12                         | PERP                        | 369.000                  | USD     | 308.947        | 0,89                         |
| ADIANT GLOBAL HOLDINGS    |                          |         |                |                              | AMER SPORTS 6,75 %          |                          |         |                |                              |
| 8,25 % 15.04.31           | 93.000                   | USD     | 98.251         | 0,28                         | 16.02.31                    | 420.000                  | USD     | 419.254        | 1,21                         |
|                           |                          |         | <b>138.175</b> | <b>0,40</b>                  | AMERICAN AIRLINES 8,5 %     |                          |         |                |                              |
| <b>LIBERIA</b>            |                          |         |                |                              | 15.05.29                    | 97.000                   | USD     | 102.519        | 0,30                         |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES   |                          |         |                |                              | AMERICAN AIRLINES           |                          |         |                |                              |
| 6,25 % 15.03.32           | 23.000                   | USD     | 23.215         | 0,07                         | ADVANTAGE 5,75 % 20.04.2029 | 325.000                  | USD     | 320.101        | 0,92                         |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES   |                          |         |                |                              | ARCHROCK PARTNERS           |                          |         |                |                              |
| 8,25 % 15.01.29           | 325.000                  | USD     | 344.410        | 0,99                         | 6,875 % 01.04.27            | 371.000                  | USD     | 372.620        | 1,07                         |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES   |                          |         |                |                              | ARSENAL AIC PARENT          |                          |         |                |                              |
| 9,25 % 15.01.29           | 86.000                   | USD     | 92.293         | 0,27                         | 11,5 % 01.10.31             | 86.000                   | USD     | 96.066         | 0,28                         |
|                           |                          |         | <b>459.918</b> | <b>1,33</b>                  | ASBURY AUTOMOTIVE GROUP     |                          |         |                |                              |
| <b>LUXEMBURG</b>          |                          |         |                |                              | 4,625 % 15.11.29            | 378.000                  | USD     | 349.710        | 1,01                         |
| BK LC LUX 5,25 %          |                          |         |                |                              | ASBURY AUTOMOTIVE GROUP     |                          |         |                |                              |
| 30.04.29                  | 100.000                  | EUR     | 108.949        | 0,31                         | 5 % 15.02.32                | 5.000                    | USD     | 4.536          | 0,01                         |
| STENA INTERNATIONAL       |                          |         |                |                              | ASCENT RESOURCES UTICA      |                          |         |                |                              |
| 7,25 % 15.01.31           | 200.000                  | USD     | 200.143        | 0,58                         | HOLDINGS 8,25 % 31.12.28    | 84.000                   | USD     | 86.359         | 0,25                         |
| TELENET FINANCE LUX       |                          |         |                |                              | AVIS BUDGET CAR RENTAL      |                          |         |                |                              |
| NOTE 3,5 % 01.03.28       | 100.000                  | EUR     | 103.511        | 0,30                         | 8 % 15.02.31                | 284.000                  | USD     | 283.728        | 0,82                         |
|                           |                          |         | <b>412.603</b> | <b>1,19</b>                  | AXALTA COATING SYSTEMS      |                          |         |                |                              |
| <b>NIEDERLANDE</b>        |                          |         |                |                              | 4,75 % 15.06.27             | 432.000                  | USD     | 417.754        | 1,21                         |
| ABERTIS INFRASTRUCTURAS   |                          |         |                |                              | BLUE RACER MIDSTREAM        |                          |         |                |                              |
| FINANCE 3,248 % VRN PERP  | 100.000                  | EUR     | 104.862        | 0,30                         | 7,625 % 15.12.25            | 184.000                  | USD     | 185.936        | 0,54                         |
| ASHLAND SERVICES 2 %      |                          |         |                |                              | BLUE RACER MIDSTREAM        |                          |         |                |                              |
| 30.01.28                  | 100.000                  | EUR     | 99.316         | 0,29                         | FINANCE 6,625 % 15.07.26    | 127.000                  | USD     | 126.936        | 0,37                         |
| CONSTELLIUM 4,25 %        |                          |         |                |                              | BUILDERS FIRSTSOURCE 5 %    |                          |         |                |                              |
| 15.02.26                  | 100.000                  | EUR     | 107.902        | 0,31                         | 01/03/2030                  | 162.000                  | USD     | 154.963        | 0,45                         |
| DUFREY ONE 2 % 15.02.2027 | 100.000                  | EUR     | 101.857        | 0,29                         | BUILDERS FIRSTSOURCE        |                          |         |                |                              |
| KONINKLIJKE KPN 6 % VRN   |                          |         |                |                              | 6,375 % 01.03.34            | 319.000                  | USD     | 320.410        | 0,92                         |
| PERP                      | 100.000                  | EUR     | 113.896        | 0,33                         | CAMELOT RETURN MERGER       |                          |         |                |                              |
| TRIVIUM PACKAGING         |                          |         |                |                              | 8,75 % 01.08.28             | 250.000                  | USD     | 256.854        | 0,74                         |
| FINANCE 3,75 % 15.08.2026 | 100.000                  | EUR     | 105.022        | 0,30                         | CCO HOLDINGS 4,75 %         |                          |         |                |                              |
| VZ VENDOR FINANCING       |                          |         |                |                              | 01/03/2030                  | 374.000                  | USD     | 321.909        | 0,93                         |
| 2,875 % 15.01.29          | 100.000                  | EUR     | 93.481         | 0,27                         | CCO HOLDINGS 6,375 %        |                          |         |                |                              |
| ZIGGO BOND 5,125 %        |                          |         |                |                              | 01/09/2029                  | 195.000                  | USD     | 185.251        | 0,53                         |
| 28.02.30                  | 280.000                  | USD     | 239.853        | 0,69                         | CHART INDUSTRIES 7,5 %      |                          |         |                |                              |
|                           |                          |         | <b>966.189</b> | <b>2,78</b>                  | 01/01/2030                  | 112.000                  | USD     | 116.421        | 0,34                         |
| <b>SPANIEN</b>            |                          |         |                |                              | CHART INDUSTRIES 9,5 %      |                          |         |                |                              |
| ALMIRALL 2,125 %          |                          |         |                |                              | 01/01/2031                  | 149.000                  | USD     | 162.620        | 0,47                         |
| 30.09.26                  | 100.000                  | EUR     | 102.878        | 0,30                         |                             |                          |         |                |                              |
|                           |                          |         | <b>102.878</b> | <b>0,30</b>                  |                             |                          |         |                |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global High Yield ESG Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung                                     | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung                                     | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--------------------------|---------|----------|------------------------------|--|--------------------------|---------|----------|------------------------------|
| CHSCOMMUNITY HEALTH SYSTEMS 5,25 % 15.05.30      | 31.000                   | USD     | 25.309   | 0,07                         | KINETIK HOLDINGS 5,875 % 15.06.30                | 280.000                  | USD     | 274.177  | 0,79                         |
| CHSCOMMUNITY HEALTH SYSTEMS 8 % 15.03.2026       | 484.000                  | USD     | 482.898  | 1,38                         | KODIAK GAS SERVICES 7,25 % 15.02.29              | 25.000                   | USD     | 25.499   | 0,07                         |
| CINEMARK 5,875 % 15.03.26                        | 195.000                  | USD     | 192.833  | 0,56                         | LABL 9,5 % 01.11.28                              | 248.000                  | USD     | 251.453  | 0,73                         |
| CLARIVATE SCIENCE HOLDINGS 4,875 % 01.07.29      | 150.000                  | USD     | 138.914  | 0,40                         | LEVEL 3 FINANCING 10,5 % 15.05.30                | 166.000                  | USD     | 171.591  | 0,49                         |
| CLOUD SOFTWARE 6,5 % 31.03.29                    | 112.000                  | USD     | 106.352  | 0,31                         | LEVI STRAUSS 3,375 % 15.03.27                    | 100.000                  | EUR     | 106.442  | 0,31                         |
| CLYDESDALE ACQUISITION HOLDINGS 6,625 % 15.04.29 | 75.000                   | USD     | 75.161   | 0,22                         | LIFEPOINT HEALTH 9,875 % 15.08.30                | 148.000                  | USD     | 154.958  | 0,45                         |
| CSC HOLDINGS 11,25 % 15.05.28                    | 200.000                  | USD     | 198.436  | 0,57                         | MACYS RETAIL HOLDINGS 5,875 % 01.04.29           | 255.000                  | USD     | 250.452  | 0,72                         |
| DANA 5,375 % 15.11.27                            | 227.000                  | USD     | 222.724  | 0,64                         | MCAFEE 7,375 % 15.02.30                          | 159.000                  | USD     | 146.825  | 0,42                         |
| DAVE BUSTERS 7,625 % 01/11/2025                  | 285.000                  | USD     | 287.402  | 0,83                         | MEDNAX 5,375 % 15.02.30                          | 205.000                  | USD     | 187.059  | 0,54                         |
| DIRECTV HOLDINGS 5,875 % 15.08.27                | 150.000                  | USD     | 142.044  | 0,41                         | MODIVCARE ESCROW ISSUER 5 % 01.10.29             | 148.000                  | USD     | 107.488  | 0,31                         |
| EMERALD DEBT MERGER 6,625 % 15.12.30             | 52.000                   | USD     | 52.604   | 0,15                         | MOZART DEBT MERGER 3,875 % 01.04.29              | 175.000                  | USD     | 159.575  | 0,46                         |
| ENCOMPASS HEALTH 4,5 % 01/02/2028                | 338.000                  | USD     | 322.088  | 0,93                         | MSCI 3,875 % 15.02.31                            | 176.000                  | USD     | 157.302  | 0,45                         |
| ENLINK MIDSTREAM 5,375 % 01/06/2029              | 263.000                  | USD     | 258.314  | 0,75                         | NATIONSTAR MORTGAGE HOLDINGS 5,125 % 15.12.30    | 419.000                  | USD     | 380.882  | 1,10                         |
| ENLINK MIDSTREAM 6,5 % 01/09/2030                | 13.000                   | USD     | 13.378   | 0,04                         | NATIONSTAR MORTGAGE HOLDINGS 6 % 15.01.27        | 150.000                  | USD     | 148.285  | 0,43                         |
| ESAB 6,25 % 15.04.29                             | 43.000                   | USD     | 43.263   | 0,12                         | NATIONSTAR MORTGAGE HOLDINGS 7,125 % 01.02.32    | 26.000                   | USD     | 25.882   | 0,07                         |
| FORTREA HOLDINGS 7,5 % 01/07/2030                | 230.000                  | USD     | 237.810  | 0,69                         | NCR 5,125 % 15.04.29                             | 127.000                  | USD     | 117.902  | 0,34                         |
| FRONTIER COMMUNICATIONS 5,875 % 15.10.27         | 190.000                  | USD     | 184.169  | 0,53                         | NCR ATLEOS ESCROW 9,5 % 01/04/2029               | 123.000                  | USD     | 131.641  | 0,38                         |
| GEN DIGITAL 7,125 % 30.09.30                     | 105.000                  | USD     | 107.950  | 0,31                         | NEXSTAR ESCROW 5,625 % 15.07.27                  | 338.000                  | USD     | 324.699  | 0,94                         |
| GRAY ESCROW 7 % 15.05.27                         | 195.000                  | USD     | 181.700  | 0,52                         | OUTFRONT MEDIA CAPITAL 4,25 % 15.01.29           | 159.000                  | USD     | 144.217  | 0,42                         |
| HERC HOLDINGS 5,5 % 15.07.27                     | 287.000                  | USD     | 282.405  | 0,81                         | OWENS MINOR 4,5 % 31.03.29                       | 185.000                  | USD     | 169.460  | 0,49                         |
| HILTON GRAND VACATIONS BORROWER 5 % 01.06.29     | 270.000                  | USD     | 252.265  | 0,73                         | OWENSBROCKWAY GLASS CONTAINER 6,625 % 13.05.27   | 250.000                  | USD     | 250.443  | 0,72                         |
| HILTON GRAND VACATIONS BORROWER 6,625 % 15.01.32 | 78.000                   | USD     | 78.298   | 0,23                         | PANTHER BF AGGREGATOR 8,5 % 15.05.27             | 284.000                  | USD     | 284.591  | 0,82                         |
| HOME POINT CAPITAL 5 % 01/02/2026                | 74.000                   | USD     | 72.503   | 0,21                         | PENNYMAC FINANCIAL SERVICES 5,375 % 15.10.25     | 179.000                  | USD     | 177.080  | 0,51                         |
| IQVIA 2,875 % 15.06.28                           | 400.000                  | EUR     | 407.367  | 1,18                         | PENNYMAC FINANCIAL SERVICES 5,75 % 15.09.31      | 274.000                  | USD     | 254.784  | 0,73                         |
| IQVIA 6,5 % 15.05.30                             | 378.000                  | USD     | 386.123  | 1,11                         | PENNYMAC FINANCIAL SERVICES 7,875 % 15.12.29     | 51.000                   | USD     | 52.466   | 0,15                         |
| IRON MOUNTAIN 5,25 % 15.07.30                    | 427.000                  | USD     | 405.004  | 1,17                         | PRAIRIE ACQUIROR 9 % 01/08/2029                  | 21.000                   | USD     | 21.691   | 0,06                         |
| JELD WEN 4,875 % 15.12.27                        | 375.000                  | USD     | 359.729  | 1,04                         | PRIME SECURITY SERVICES BORROWER 6,25 % 15.01.28 | 244.000                  | USD     | 239.331  | 0,69                         |
|  |                          |         |          |                              | SEAGATE 8,25 % 15.12.29                          | 355.000                  | USD     | 382.206  | 1,10                         |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global High Yield ESG Bond (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|--|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|
| SELECT MEDICAL 6,25 %<br>15.08.26   | 137.000                  | USD     | 137.433           | 0,40                         | <b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>                   |                          |         |                   |                              |
| SIRIUS XM RADIO 5 %<br>01/08/2027   | 280.000                  | USD     | 270.001           | 0,78                         | <b>IRLAND</b>  |                          |         |                   |                              |
| SPRINGLEAF FINANCE<br>6,625 % 15.01.28  | 99.000                   | USD     | 99.509            | 0,29                         | HSBC GLOBAL LIQUIDITY<br>FUND                              | 1.012.433                | USD     | 1.012.432         | 2,92                         |
| SPRINGLEAF FINANCE CORP<br>6,875 % 15.03.25   | 179.000                  | USD     | 180.966           | 0,52                         | HSBC US DOLLAR ESG<br>LIQUIDITY FUND Y INC                 | 4                        | USD     | 4                 | 0,00                         |
| STANDARD INDUSTRIES 4,75 %<br>15.01.28  | 95.000                   | USD     | 90.801            | 0,26                         |  |                          |         | <b>1.012.436</b>  | <b>2,92</b>                  |
| STANDARD INDUSTRIES 5 %<br>15.02.27   | 279.000                  | USD     | 271.305           | 0,78                         | <b>LUXEMBURG</b>   |                          |         |                   |                              |
| SUMMIT MATERIALS 7,25 %<br>15.01.31   | 24.000                   | USD     | 24.966            | 0,07                         | HGIF GLOBAL ASSET<br>BACKED HIGH YIELD „ZC“                | 3.831                    | USD     | 922.548           | 2,66                         |
| SUNOCO LP SUNOCO<br>FINANCE 7 % 15.09.28  | 78.000                   | USD     | 79.807            | 0,23                         |  |                          |         | <b>922.548</b>    | <b>2,66</b>                  |
| SURGERY CENTER HOLDINGS<br>6,75 % 01.07.25  | 41.000                   | USD     | 41.021            | 0,12                         | <b>SUMME ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>             |                          |         | <b>1.934.984</b>  | <b>5,58</b>                  |
| SURGERY CENTER HOLDINGS<br>7,25 % 15.04.32  | 87.000                   | USD     | 87.605            | 0,25                         | <b>SUMME WERTPAPIERANLAGEN</b>                             |                          |         | <b>34.349.353</b> | <b>99,08</b>                 |
| TENET HEALTHCARE 6,125 %<br>01/10/2028  | 250.000                  | USD     | 249.560           | 0,72                         | <b>SONSTIGES NETTOVERMÖGEN ABZÜGLICH VERBINDLICHKEITEN</b> |                          |         | <b>317.777</b>    | <b>0,92</b>                  |
| UBER TECHNOLOGIES 8 %<br>01/11/2026   | 300.000                  | USD     | 303.850           | 0,88                         | <b>GESAMTNETTOVERMÖGEN</b>                                 |                          |         | <b>34.667.130</b> | <b>100,00</b>                |
| UNITED RENTALS NORTH<br>AMERICA 5,25 % 15.01.30                                     | 153.000                  | USD     | 149.530           | 0,43                         |  |                          |         |                   |                              |
| VENTURE GLOBAL 8,125 %<br>01/06/2028  | 267.000                  | USD     | 272.969           | 0,79                         |  |                          |         |                   |                              |
| VIKING CRUISES 9,125 %<br>15.07.31  | 72.000                   | USD     | 78.876            | 0,23                         |  |                          |         |                   |                              |
| VIKING OCEAN CRUISES<br>5,625 % 15.02.29  | 170.000                  | USD     | 165.853           | 0,48                         |  |                          |         |                   |                              |
| VINE ENERGY HOLDINGS<br>6,75 % 15.04.29   | 473.000                  | USD     | 478.668           | 1,37                         |  |                          |         |                   |                              |
| WAND NEWCO 7,625 %<br>30.01.32  | 46.000                   | USD     | 47.645            | 0,14                         |  |                          |         |                   |                              |
| WASH MULTIFAMILY ACQUISITION<br>5,75 % 15.04.26                                     | 126.000                  | USD     | 123.399           | 0,36                         |  |                          |         |                   |                              |
| WR GRACE HOLDINGS<br>5,625 % 15.08.29   | 235.000                  | USD     | 210.597           | 0,61                         |  |                          |         |                   |                              |
| WR GRACE HOLDINGS<br>7,375 % 01.03.31   | 42.000                   | USD     | 42.664            | 0,12                         |  |                          |         |                   |                              |
| WYNDHAM DESTINATIONS<br>6,625 % 31.07.26  | 461.000                  | USD     | 464.782           | 1,34                         |  |                          |         |                   |                              |
|   |                          |         | <b>19.242.022</b> | <b>55,50</b>                 |  |                          |         |                   |                              |
| <b>SUMME ANLEIHEN</b>   |                          |         | <b>24.420.828</b> | <b>70,44</b>                 |  |                          |         |                   |                              |
| <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN<br/>MARKT GEHANDELTEN ÜBERTRAGBAREN WERTPAPIERE</b> |                          |         | <b>24.420.828</b> | <b>70,44</b>                 |  |                          |         |                   |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global High Yield Securitised Credit Bond  
Aufstellung der Wertpapiieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung              | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--------------------------|---------|------------------|------------------------------|---------------------------|--------------------------|---------|------------------|------------------------------|
| <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>   |                          |         |                  |                              | <b>ELM PARK CLO FRN</b>   |                          |         |                  |                              |
| <b>AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>            |                          |         |                  |                              | 15.04.34                  |                          |         |                  |                              |
| <b>ANLEIHEN</b>  |                          |         |                  |                              | 15.04.34                  |                          |         |                  |                              |
| <b>CHINA</b>   |                          |         |                  |                              | 15.04.34                  |                          |         |                  |                              |
| TRAFFORD CENTRE FINANCE  |                          |         |                  |                              | 15.04.34                  | 1.000.000                | EUR     | 1.065.692        | 1,31                         |
| 4,75 % 28.04.24  | 500.000                  | GBP     | 627.431          | 0,77                         | FROST FRN 22.11.2026      | 1.000.000                | GBP     | 1.115.985        | 1,37                         |
|  |                          |         | <b>627.431</b>   | <b>0,77</b>                  | INVESCO CLO FRN           |                          |         |                  |                              |
| <b>GROSSBRITANNIEN</b>   |                          |         |                  |                              | 15.07.34                  |                          |         |                  |                              |
| GREENE KING FINANCE FRN  |                          |         |                  |                              | 15.07.34                  | 750.000                  | USD     | 711.288          | 0,87                         |
| 15.03.36   | 1.500.000                | GBP     | 1.536.329        | 1,89                         | INVESCO CLO FRN           |                          |         |                  |                              |
|  |                          |         | <b>1.536.329</b> | <b>1,89</b>                  | 15.07.2034 (US46149MAE66) | 1.000.000                | USD     | 977.876          | 1,20                         |
| <b>SUMME ANLEIHEN</b>  |                          |         |                  |                              | INVESCO EURO CLO FRN      |                          |         |                  |                              |
|  |                          |         | <b>2.163.760</b> | <b>2,66</b>                  | 15.07.31                  | 1.000.000                | EUR     | 1.052.080        | 1,29                         |
| <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>                                      |                          |         |                  |                              | INVESCO EURO CLO FRN      |                          |         |                  |                              |
| <b>AUSTRALIEN</b>  |                          |         |                  |                              | 15.04.33                  |                          |         |                  |                              |
| FIRSTMAC MORTGAGE FUNDING  |                          |         |                  |                              | 15.04.33                  | 1.000.000                | EUR     | 1.052.844        | 1,29                         |
| TRUST FRN 15.01.52   | 1.000.000                | AUD     | 517.462          | 0,64                         | LAST MILE SECURITIES      |                          |         |                  |                              |
|  |                          |         | <b>517.462</b>   | <b>0,64</b>                  | FRN 17.08.31              | 657.000                  | EUR     | 690.058          | 0,85                         |
| <b>GROSSBRITANNIEN</b>   |                          |         |                  |                              | LAST MILE SECURITIES FRN  |                          |         |                  |                              |
| MARSTONS ISSUER 5,641 %  |                          |         |                  |                              | 17.08.2031 (XS2320421766) | 1.500.000                | EUR     | 1.558.491        | 1,93                         |
| VRN 15.07.35   | 1.108.000                | GBP     | 1.046.687        | 1,28                         | TAURUS FRN 22.12.30       | 1.000.000                | EUR     | 963.093          | 1,18                         |
|  |                          |         | <b>1.046.687</b> | <b>1,28</b>                  | TAURUS FRN 17.05.2031     |                          |         |                  |                              |
| <b>SUMME FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>                                |                          |         |                  |                              | (XS2303819929)            |                          |         |                  |                              |
|  |                          |         | <b>2.897.158</b> | <b>3,56</b>                  | TAURUS FRN 17.05.2031     | 1.000.000                | GBP     | 1.232.134        | 1,52                         |
| <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTEN WERTPAPIERE</b>              |                          |         |                  |                              | (XS2303820349)            |                          |         |                  |                              |
|  |                          |         | <b>5.060.918</b> | <b>6,22</b>                  |                           | 700.000                  | GBP     | 844.833          | 1,04                         |
| <b>WERTPAPIERE</b>   |                          |         |                  |                              | <b>ITALIEN</b>            |                          |         |                  |                              |
| <b>AN EINEM ANDEREM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE, ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |                          |         |                  |                              | ERNA FRN 25.07.2031       |                          |         |                  |                              |
| <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>                                      |                          |         |                  |                              | ERNA FRN 25.07.2031       |                          |         |                  |                              |
| <b>IRLAND</b>  |                          |         |                  |                              | 2.200.000                 |                          |         |                  |                              |
| CONTEGO CLO VI DAC   |                          |         |                  |                              |                           |                          |         | 1.092.322        | 1,34                         |
| FRN 15.04.34   | 1.000.000                | EUR     | 1.072.499        | 1,32                         |                           |                          |         | <b>1.092.322</b> | <b>1,34</b>                  |
| DILOSK RMBS FRN  |                          |         |                  |                              | <b>USA</b>                |                          |         |                  |                              |
| 20.05.62   | 600.000                  | EUR     | 653.756          | 0,80                         | 280 PARK AVENUE MORTGAGE  |                          |         |                  |                              |
|  |                          |         |                  |                              | TRUST FRN 15.09.34        | 1.985.000                | USD     | 1.831.398        | 2,25                         |
| <b>AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>            |                          |         |                  |                              | ALIGNED DATA CENTERS      |                          |         |                  |                              |
| <b>ANLEIHEN</b>  |                          |         |                  |                              | ISSUER 2,482 % 15.08.46   |                          |         |                  |                              |
| <b>CHINA</b>   |                          |         |                  |                              | ALLEGANY PARK CLO FRN     |                          |         |                  |                              |
| <b>TRAFFORD CENTRE FINANCE</b>   |                          |         |                  |                              | 20.01.35                  |                          |         |                  |                              |
| <b>4,75 % 28.04.24</b>   |                          |         |                  |                              | ALLEGANY PARK CLO FRN     |                          |         |                  |                              |
| <b>500.000 GBP</b>   |                          |         |                  |                              | 20.01.2035 (US017154AS48) |                          |         |                  |                              |
| <b>627.431 0,77</b>  |                          |         |                  |                              | 20.01.35                  |                          |         |                  |                              |
| <b>GROSSBRITANNIEN</b>   |                          |         |                  |                              | 20.01.2035 (US017154AS48) |                          |         |                  |                              |
| <b>GREENE KING FINANCE FRN</b>   |                          |         |                  |                              | 20.01.35                  |                          |         |                  |                              |
| <b>15.03.36</b>  |                          |         |                  |                              | 20.01.35                  |                          |         |                  |                              |
| <b>1.500.000 GBP</b>   |                          |         |                  |                              | 20.01.35                  |                          |         |                  |                              |
| <b>1.536.329 1,89</b>  |                          |         |                  |                              | 20.01.35                  |                          |         |                  |                              |
| <b>SUMME ANLEIHEN</b>  |                          |         |                  |                              | 20.01.35                  |                          |         |                  |                              |
| <b>2.163.760 2,66</b>  |                          |         |                  |                              | 20.01.35                  |                          |         |                  |                              |
| <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>                                      |                          |         |                  |                              | 20.01.35                  |                          |         |                  |                              |
| <b>AUSTRALIEN</b>  |                          |         |                  |                              | 20.01.35                  |                          |         |                  |                              |
| <b>FIRSTMAC MORTGAGE FUNDING</b>   |                          |         |                  |                              | 20.01.35                  |                          |         |                  |                              |
| <b>TRUST FRN 15.01.52</b>  |                          |         |                  |                              | 20.01.35                  |                          |         |                  |                              |
| <b>1.000.000 AUD</b>   |                          |         |                  |                              | 20.01.35                  |                          |         |                  |                              |
| <b>517.462 0,64</b>  |                          |         |                  |                              | 20.01.35                  |                          |         |                  |                              |
| <b>GROSSBRITANNIEN</b>   |                          |         |                  |                              | 20.01.35                  |                          |         |                  |                              |
| <b>MARSTONS ISSUER 5,641 %</b>   |                          |         |                  |                              | 20.01.35                  |                          |         |                  |                              |
| <b>VRN 15.07.35</b>  |                          |         |                  |                              | 20.01.35                  |                          |         |                  |                              |
| <b>1.108.000 GBP</b>   |                          |         |                  |                              | 20.01.35                  |                          |         |                  |                              |
| <b>1.046.687 1,28</b>  |                          |         |                  |                              | 20.01.35                  |                          |         |                  |                              |
| <b>SUMME FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>                                |                          |         |                  |                              | 20.01.35                  |                          |         |                  |                              |
| <b>2.897.158 3,56</b>  |                          |         |                  |                              | 20.01.35                  |                          |         |                  |                              |
| <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTEN WERTPAPIERE</b>              |                          |         |                  |                              | 20.01.35                  |                          |         |                  |                              |
| <b>5.060.918 6,22</b>  |                          |         |                  |                              | 20.01.35                  |                          |         |                  |                              |
| <b>WERTPAPIERE</b>   |                          |         |                  |                              | 20.01.35                  |                          |         |                  |                              |
| <b>AN EINEM ANDEREM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE, ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |                          |         |                  |                              | 20.01.35                  |                          |         |                  |                              |
| <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>                                      |                          |         |                  |                              | 20.01.35                  |                          |         |                  |                              |
| <b>IRLAND</b>  |                          |         |                  |                              | 20.01.35                  |                          |         |                  |                              |
| <b>CONTEGO CLO VI DAC</b>  |                          |         |                  |                              | 20.01.35                  |                          |         |                  |                              |
| <b>FRN 15.04.34</b>  |                          |         |                  |                              | 20.01.35                  |                          |         |                  |                              |
| <b>1.000.000 EUR</b>   |                          |         |                  |                              | 20.01.35                  |                          |         |                  |                              |
| <b>1.072.499 1,32</b>  |                          |         |                  |                              | 20.01.35                  |                          |         |                  |                              |
| <b>DILOSK RMBS FRN</b>   |                          |         |                  |                              | 20.01.35                  |                          |         |                  |                              |
| <b>20.05.62</b>  |                          |         |                  |                              | 20.01.35                  |                          |         |                  |                              |
| <b>600.000 EUR</b>   |                          |         |                  |                              | 20.01.35                  |                          |         |                  |                              |
| <b>653.756 0,80</b>  |                          |         |                  |                              | 20.01.35                  |                          |         |                  |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global High Yield Securitised Credit Bond (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapiieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert  | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|-----------|------------------------------|---|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|
| BIOD MORTGAGE TRUST FRN<br>15.05.35                             | 1.200.000                | USD     | 1.073.309 | 1,32                         | PROGRESS RESIDENTIAL<br>3,01 % 17.11.40                   | 341.000                  | USD     | 296.081           | 0,36                         |
| BOYCE PARK CLO FRN<br>21.04.35                                  | 1.000.000                | USD     | 988.645   | 1,22                         | PROGRESS RESIDENTIAL<br>3,407 % 17.05.38                  | 2.000.000                | USD     | 1.819.652         | 2,24                         |
| BWAY MORTGAGE TRUST<br>3,6332 % 10.03.33                        | 750.000                  | USD     | 653.539   | 0,80                         | PROGRESS RESIDENTIAL<br>4,65 % 17.03.40                   | 500.000                  | USD     | 474.831           | 0,58                         |
| BWAY MORTGAGE TRUST<br>3,927 % VRN 10.03.33                     | 1.100.000                | USD     | 933.637   | 1,15                         | PROGRESS RESIDENTIAL<br>6,15 % 17.03.40                   | 500.000                  | USD     | 488.553           | 0,60                         |
| BX TRUST FRN 25.11.2028   | 2.510.000                | USD     | 1.746.920 | 2,15                         | PROGRESS RESIDENTIAL<br>TRUST 2,225 % 17.07.38            | 1.000.000                | USD     | 913.306           | 1,12                         |
| CAMB COMMERCIAL MORTGAGE<br>TRUST FRN 15.12.37                  | 1.174.000                | USD     | 1.166.685 | 1,43                         | PROGRESS RESIDENTIAL<br>TRUST 3,181 % 17.09.38            | 1.000.000                | USD     | 896.841           | 1,10                         |
| CAMB COMMERCIAL MORTGAGE TRUST FRN<br>15.12.2037 (US12482HAS31) | 1.000.000                | USD     | 991.360   | 1,22                         | PROGRESS RESIDENTIAL<br>TRUST 3,422 % 17.07.38            | 261.434                  | USD     | 237.653           | 0,29                         |
| CORE MORTGAGE TRUST FRN<br>15.12.31                             | 2.340.000                | USD     | 1.685.401 | 2,07                         | PROGRESS RESIDENTIAL<br>TRUST 4,053 % 17.11.40            | 1.292.000                | USD     | 1.121.498         | 1,38                         |
| FREDDIE MAC FRN<br>25.08.33                                     | 1.500.000                | USD     | 1.314.482 | 1,62                         | WHETSTONE PARK CLO FRN<br>20.01.35                        | 1.000.000                | USD     | 967.358           | 1,19                         |
| FREDDIE MAC STACR REMIC<br>TRUST FRN 25.10.33                   | 1.490.000                | USD     | 1.516.998 | 1,86                         | <b>SUMME FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>             |                          |         | <b>53.819.758</b> | <b>66,17</b>                 |
| FREDDIE MAC STACR REMIC<br>TRUST FRN 25.01.51                   | 1.000.000                | USD     | 650.409   | 0,80                         | <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN</b>                       |                          |         | <b>67.902.709</b> | <b>83,48</b>                 |
| GILBERT PARK FRN<br>15.10.30                                    | 1.625.697                | USD     | 1.623.210 | 2,00                         | <b>MARKT GEHANDELTEN ÜBERTRAGBAREN WERTPAPIERE</b>        |                          |         | <b>67.902.709</b> | <b>83,48</b>                 |
| HPS LOAN MANAGEMENT<br>15-2019 FRN 22.01.2035                   | 1.000.000                | USD     | 964.642   | 1,19                         | <b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>                  |                          |         |                   |                              |
| HPS LOAN MANAGEMENT FRN<br>25.01.34                             | 1.000.000                | USD     | 964.989   | 1,19                         | <b>IRLAND</b>   |                          |         |                   |                              |
| HUDSON YARDS 3,557 % VRN<br>10/07/2039                          | 1.500.000                | USD     | 1.264.560 | 1,55                         | HSBC US DOLLAR ESG<br>LIQUIDITY FUND Y INC                | 1.833.022                | USD     | 1.833.022         | 2,25                         |
| INVESCO CLO FRN<br>22.04.37                                     | 2.000.000                | USD     | 1.989.139 | 2,45                         | <b>SUMME ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>            |                          |         | <b>1.833.022</b>  | <b>2,25</b>                  |
| MADISON PARK FUNDING<br>FRN 15.07.30                            | 1.000.000                | USD     | 940.214   | 1,16                         | <b>SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>                  |                          |         | <b>1.833.022</b>  | <b>2,25</b>                  |
| MADISON PARK FUNDING<br>FRN 21.07.30                            | 1.500.000                | USD     | 1.461.863 | 1,80                         | <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>                   |                          |         |                   |                              |
| MORGAN STANLEY CAPITAL<br>FRN 15.12.38                          | 2.000.000                | USD     | 1.878.186 | 2,31                         | <b>IRLAND</b>   |                          |         |                   |                              |
| NEUBERGER BERMAN LOAN<br>ADVISERS FRN 23.04.2038                | 2.000.000                | USD     | 1.999.999 | 2,46                         | ATOM MORTGAGE SECURITIES FRN<br>22.07.31                  | 1.513.000                | GBP     | 1.362.078         | 1,67                         |
| NEUBERGER BERMAN LOAN<br>CLO FRN 18.10.2030                     | 1.000.000                | USD     | 970.556   | 1,19                         | ATOM MORTGAGE SECURITIES FRN<br>22.07.2031 (XS2373058689) | 1.000.000                | GBP     | 845.949           | 1,04                         |
| PEEBLES PARK CLO FRN<br>21.04.37                                | 2.000.000                | USD     | 1.999.999 | 2,46                         | <b>SUMME FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>             |                          |         | <b>2.208.027</b>  | <b>2,71</b>                  |
| PIKES PEAK CLO FRN<br>20.04.33                                  | 1.000.000                | USD     | 961.990   | 1,18                         | <b>USA</b>  |                          |         |                   |                              |
| PIKES PEAK CLO FRN<br>20.04.36                                  | 1.500.000                | USD     | 1.512.767 | 1,86                         | APIDOS CLO FRN 17.07.30                                   | 1.250.000                | USD     | 1.214.478         | 1,50                         |
| PREFERRED TERM FRN<br>22.09.36                                  | 2.759.000                | USD     | 205.728   | 0,25                         | APIDOS CLO FRN 15.04.33                                   | 1.000.000                | USD     | 953.439           | 1,17                         |
| PROGRESS RESIDENTIAL<br>2,209 % 17.07.38                        | 350.000                  | USD     | 317.496   | 0,39                         | PIKES PEAK CLO FRN<br>15.07.34                            | 1.000.000                | USD     | 952.949           | 1,17                         |
|   |                          |         |           |                              | <b>SUMME SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>            |                          |         | <b>3.120.866</b>  | <b>3,84</b>                  |
|   |                          |         |           |                              | <b>SUMME WERTPAPIERANLAGEN</b>                            |                          |         | <b>5.328.893</b>  | <b>6,55</b>                  |
|   |                          |         |           |                              | <b>SONSTIGES NETTOVERMÖGEN</b>                            |                          |         | <b>80.125.542</b> | <b>98,50</b>                 |
|   |                          |         |           |                              | <b>GESAMTNETTOVERMÖGEN</b>                                |                          |         | <b>1.223.872</b>  | <b>1,50</b>                  |
|   |                          |         |           |                              |   |                          |         | <b>81.349.414</b> | <b>100,00</b>                |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Inflation Linked Bond

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung           | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|------------------------|--------------------------|---------|----------|------------------------------|
| <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>  |                          |         |                   |                              | <b>DEUTSCHLAND</b>     |                          |         |          |                              |
| <b>AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |                          |         |                   |                              | GERMANY (GOVT) 0,1 %   |                          |         |          |                              |
| <b>ANLEIHEN</b>   |                          |         |                   |                              | 15.04.26               |                          |         |          |                              |
| <b>AUSTRALIEN</b>   |                          |         |                   |                              | GERMANY (GOVT) 0,1 %   |                          |         |          |                              |
| AUSTRALIA (GOVT) 0,25 %   |                          |         |                   |                              | 15.04.33               |                          |         |          |                              |
| 21.11.32  | 11.300.000               | AUD     | 7.631.368         | 1,31                         | GERMANY (GOVT) 0,1 %   |                          |         |          |                              |
| AUSTRALIA (GOVT) 0,75 %   |                          |         |                   |                              | 15.04.46               |                          |         |          |                              |
| 21.11.27  | 7.500.000                | AUD     | 5.921.266         | 1,01                         | GERMANY (GOVT) 0,5 %   |                          |         |          |                              |
| AUSTRALIA (GOVT) 1 %  |                          |         |                   |                              | 15.04.30               |                          |         |          |                              |
| 21.02.50  | 3.600.000                | AUD     | 2.372.100         | 0,41                         |                        |                          |         |          |                              |
| AUSTRALIA (GOVT) 1,25 %   |                          |         |                   |                              | <b>70.921.506</b>      |                          |         |          |                              |
| 21.08.40  | 3.300.000                | AUD     | 2.563.226         | 0,44                         | <b>12,15</b>           |                          |         |          |                              |
| AUSTRALIA (GOVT) 1,75 %   |                          |         |                   |                              | <b>DEUTSCHLAND</b>     |                          |         |          |                              |
| 21.06.51  | 1.500.000                | AUD     | 572.630           | 0,10                         | GERMANY (GOVT) 0,125 % |                          |         |          |                              |
| AUSTRALIA (GOVT) 2 %  |                          |         |                   |                              | 22.03.26               |                          |         |          |                              |
| 21.08.35  | 1.000.000                | AUD     | 902.043           | 0,15                         | UK (GOVT) 0,125 %      |                          |         |          |                              |
| AUSTRALIA (GOVT) 2,5 %  |                          |         |                   |                              | 10/08/2028             |                          |         |          |                              |
| 20.09.30  | 3.300.000                | AUD     | 3.284.913         | 0,56                         | UK (GOVT) 0,125 %      |                          |         |          |                              |
| AUSTRALIA (GOVT) 3 %  |                          |         |                   |                              | 22.03.29               |                          |         |          |                              |
| 20.09.25  | 2.250.000                | AUD     | 2.200.782         | 0,38                         | UK (GOVT) 0,125 %      |                          |         |          |                              |
|   |                          |         | <b>25.448.328</b> | <b>4,36</b>                  | 10/08/2031             |                          |         |          |                              |
| <b>KANADA</b>   |                          |         |                   |                              | UK (GOVT) 0,125 %      |                          |         |          |                              |
| CANADA (GOVT) 4,25 %  |                          |         |                   |                              | 22.11.36               |                          |         |          |                              |
| 01/12/2026  | 3.200.000                | CAD     | 4.555.861         | 0,78                         | UK (GOVT) 0,125 %      |                          |         |          |                              |
|   |                          |         | <b>4.555.861</b>  | <b>0,78</b>                  | 22.03.44               |                          |         |          |                              |
| <b>FRANKREICH</b>   |                          |         |                   |                              | UK (GOVT) 0,125 %      |                          |         |          |                              |
| FRANCE (GOVT) 0,1 %   |                          |         |                   |                              | 10/08/2048             |                          |         |          |                              |
| 01/03/2025  | 3.800.000                | EUR     | 4.768.126         | 0,82                         | UK (GOVT) 0,25 %       |                          |         |          |                              |
| FRANCE (GOVT) 0,1 %   |                          |         |                   |                              | 22.03.52               |                          |         |          |                              |
| 01/03/2026  | 950.000                  | EUR     | 1.192.830         | 0,20                         | UK (GOVT) 0,5 %        |                          |         |          |                              |
| FRANCE (GOVT) 0,1 %   |                          |         |                   |                              | 22.03.50               |                          |         |          |                              |
| 01/03/2028  | 5.700.000                | EUR     | 7.087.652         | 1,21                         | UK (GOVT) 0,625 %      |                          |         |          |                              |
| FRANCE (GOVT) 0,1 %   |                          |         |                   |                              | 22.03.40               |                          |         |          |                              |
| 01/03/2029  | 2.400.000                | EUR     | 3.024.737         | 0,52                         | UK (GOVT) 0,625 %      |                          |         |          |                              |
| FRANCE (GOVT) 0,1 %   |                          |         |                   |                              | 22.11.42               |                          |         |          |                              |
| 25.07.31  | 1.750.000                | EUR     | 2.174.332         | 0,37                         | UK (GOVT) 0,75 %       |                          |         |          |                              |
| FRANCE (GOVT) 0,1 %   |                          |         |                   |                              | 22.03.34               |                          |         |          |                              |
| 25.07.38  | 9.000.000                | EUR     | 10.336.437        | 1,77                         | UK (GOVT) 1,125 %      |                          |         |          |                              |
| FRANCE (GOVT) 0,1 %   |                          |         |                   |                              | 22.11.37               |                          |         |          |                              |
| 25.07.53  | 1.450.000                | EUR     | 1.524.086         | 0,26                         | <b>123.575.427</b>     |                          |         |          |                              |
| FRANCE (GOVT) 0,6 %   |                          |         |                   |                              | <b>21,17</b>           |                          |         |          |                              |
| 25.07.34  | 500.000                  | EUR     | 578.616           | 0,10                         | <b>ITALIEN</b>         |                          |         |          |                              |
| FRANCE (GOVT) 0,7 %   |                          |         |                   |                              | ITALY (GOVT) 0,10 %    |                          |         |          |                              |
| 25.07.30  | 200.000                  | EUR     | 272.259           | 0,05                         | 15.05.33               |                          |         |          |                              |
| FRANCE (GOVT) 1,8 %   |                          |         |                   |                              | ITALY (GOVT) 1,3 %     |                          |         |          |                              |
| 25.07.40  | 200.000                  | EUR     | 355.151           | 0,06                         | 15.05.28               |                          |         |          |                              |
| FRANCE (GOVT) 3,15 %  |                          |         |                   |                              | ITALY (GOVT) 1,5 %     |                          |         |          |                              |
| 25.07.32  | 500.000                  | EUR     | 1.001.148         | 0,17                         | 15.05.29               |                          |         |          |                              |
|   |                          |         | <b>32.315.374</b> | <b>5,53</b>                  | ITALY (GOVT) 2,4 %     |                          |         |          |                              |
| <b>JAPAN</b>  |                          |         |                   |                              | 15.05.39               |                          |         |          |                              |
| JAPAN (GOVT) 0,2 %  |                          |         |                   |                              | 15.05.39               |                          |         |          |                              |
| 10/03/2030  | 290.000.000              | JPY     | 2.235.067         | 0,38                         | 15.09.41               |                          |         |          |                              |
|   |                          |         | <b>2.235.067</b>  | <b>0,38</b>                  |                        |                          |         |          |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Inflation Linked Bond (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung             | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--------------------------|---------|--------------------|------------------------------|--------------------------|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|
| <b>MEXIKO</b>  |                          |         |                    |                              | CANADA (GOVT) 3 %        |                          |         |                   |                              |
| MEXICO (GOVT) 4,5 %  |                          |         |                    |                              | 01/12/2036               | 2.250.000                | CAD     | 2.920.117         | 0,50                         |
| 22.11.35   | 70.000                   | MXN     | 3.302.476          | 0,57                         | CANADA (GOVT) 4 %        |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         | <b>3.302.476</b>   | <b>0,57</b>                  | 01/12/2031               | 3.500.000                | CAD     | 5.249.826         | 0,90                         |
| <b>NEUSEELAND</b>  |                          |         |                    |                              |                          |                          |         | <b>15.684.259</b> | <b>2,69</b>                  |
| NEW ZEALAND (GOVT)   |                          |         |                    |                              | <b>FRANKREICH</b>        |                          |         |                   |                              |
| 1,75 % 15.05.41  | 3.700.000                | NZD     | 1.417.164          | 0,24                         | FRANCE (GOVT) 0,1 %      |                          |         |                   |                              |
| NEW ZEALAND (GOVT)   |                          |         |                    |                              | 25.07.47                 | 2.050.000                | EUR     | 2.344.772         | 0,40                         |
| 2,75 % 15.04.25  | 6.000.000                | NZD     | 3.502.026          | 0,60                         |                          |                          |         | <b>2.344.772</b>  | <b>0,40</b>                  |
| NEW ZEALAND (GOVT) 3,5 %   |                          |         |                    |                              | <b>ITALIEN</b>           |                          |         |                   |                              |
| 14.04.33   | 24.000.000               | NZD     | 13.258.866         | 2,27                         | ITALY (GOVT) 0,15 %      |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         | <b>18.178.056</b>  | <b>3,11</b>                  | 15.05.51                 | 4.150.000                | EUR     | 3.516.449         | 0,60                         |
| <b>SPANIEN</b>   |                          |         |                    |                              | ITALY (GOVT) 0,4 %       |                          |         |                   |                              |
| SPAIN (GOVT) 0,65 %  |                          |         |                    |                              | 15.05.30                 | 3.950.000                | EUR     | 4.808.226         | 0,82                         |
| 30.11.27   | 1.000.000                | EUR     | 1.324.292          | 0,23                         | ITALY (GOVT) 0,65 %      |                          |         |                   |                              |
| SPAIN (GOVT) 0,7 %   |                          |         |                    |                              | 15.05.26                 | 6.000.000                | EUR     | 7.534.656         | 1,30                         |
| 30.11.33   | 7.500.000                | EUR     | 9.549.067          | 1,63                         |                          |                          |         | <b>15.859.331</b> | <b>2,72</b>                  |
| SPAIN (GOVT) 1 %   |                          |         |                    |                              | <b>JAPAN</b>             |                          |         |                   |                              |
| 30.11.30   | 5.100.000                | EUR     | 6.864.765          | 1,18                         | JAPAN (GOVT) 0,005 %     |                          |         |                   |                              |
| SPAIN (GOVT) 2,05 %  |                          |         |                    |                              | 10/03/2031               | 320.000.000              | JPY     | 2.436.991         | 0,42                         |
| 30.11.39   | 6.200.000                | EUR     | 7.661.831          | 1,31                         |                          |                          |         | <b>2.436.991</b>  | <b>0,42</b>                  |
|  |                          |         | <b>25.399.955</b>  | <b>4,35</b>                  | <b>NEUSEELAND</b>        |                          |         |                   |                              |
| <b>SCHWEDEN</b>  |                          |         |                    |                              |                          |                          |         |                   |                              |
| SWEDEN (GOVT) 1 %  |                          |         |                    |                              | NEW ZEALAND (GOVT) 2,5 % |                          |         |                   |                              |
| 01/06/2025   | 18.000.000               | SEK     | 2.180.092          | 0,37                         | 20.09.35                 | 2.900.000                | NZD     | 2.203.094         | 0,38                         |
| SWEDEN (GOVT) 3,5 %  |                          |         |                    |                              |                          |                          |         | <b>2.203.094</b>  | <b>0,38</b>                  |
| 01/12/2028   | 20.750.000               | SEK     | 3.483.726          | 0,60                         | <b>SCHWEDEN</b>          |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         | <b>5.663.818</b>   | <b>0,97</b>                  | SWEDEN (GOVT) 0,125 %    |                          |         |                   |                              |
| <b>USA</b>   |                          |         |                    |                              | 01/06/2026               | 66.000.000               | SEK     | 7.874.207         | 1,35                         |
| US (GOVT) 1,125 %  |                          |         |                    |                              | SWEDEN (GOVT) 0,125 %    |                          |         |                   |                              |
| 15.01.33   | 33.150.000               | USD     | 32.212.930         | 5,52                         | 01/06/2030               | 18.000.000               | SEK     | 1.971.093         | 0,34                         |
| US (GOVT) 1,5 % IL   |                          |         |                    |                              | SWEDEN (GOVT) 0,125 %    |                          |         |                   |                              |
| 15.02.53   | 3.300.000                | USD     | 2.996.019          | 0,51                         | 01/06/2032               | 13.000.000               | SEK     | 1.523.662         | 0,26                         |
|  |                          |         | <b>35.208.949</b>  | <b>6,03</b>                  |                          |                          |         | <b>11.368.962</b> | <b>1,95</b>                  |
| <b>SUMME ANLEIHEN</b>  |                          |         |                    |                              | <b>USA</b>               |                          |         |                   |                              |
| <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN</b>                              |                          |         |                    |                              | US (GOVT) 0,125 %        |                          |         |                   |                              |
| <b>BÖRSE NOTIERTEN WERTPAPIERE</b>                               |                          |         |                    |                              | 15.04.25                 | 1.100.000                | USD     | 1.280.239         | 0,22                         |
| <b>WERTPAPIERE</b>   |                          |         |                    |                              | US (GOVT) 0,125 %        |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         | <b>372.414.869</b> | <b>63,79</b>                 | 15.07.30                 | 6.300.000                | USD     | 6.829.689         | 1,17                         |
| <b>AN EINEM ANDEREM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE, ÜBERTRAGBARE</b> |                          |         |                    |                              | US (GOVT) 0,125 %        |                          |         |                   |                              |
| <b>WERTPAPIERE</b>   |                          |         |                    |                              | 15.01.31                 | 6.900.000                | USD     | 7.275.622         | 1,25                         |
|  |                          |         |                    |                              | US (GOVT) 0,125 %        |                          |         |                   |                              |
| <b>ANLEIHEN</b>  |                          |         |                    |                              | 15.01.32                 | 18.800.000               | USD     | 18.285.482        | 3,13                         |
| <b>KANADA</b>  |                          |         |                    |                              | US (GOVT) 0,125 %        |                          |         |                   |                              |
| CANADA (GOVT) 0,5 %  |                          |         |                    |                              | 15.02.51                 | 9.350.000                | USD     | 6.641.360         | 1,14                         |
| 01/12/2050   | 4.300.000                | CAD     | 3.033.826          | 0,52                         | US (GOVT) 0,125 %        |                          |         |                   |                              |
| CANADA (GOVT) 1,25 %   |                          |         |                    |                              | 15.02.52                 | 10.400.000               | USD     | 6.798.174         | 1,16                         |
| 01/12/2047   | 1.900.000                | CAD     | 1.674.089          | 0,29                         | US (GOVT) 0,375 %        |                          |         |                   |                              |
| CANADA (GOVT) 1,75 %   |                          |         |                    |                              | 15.07.25                 | 5.950.000                | USD     | 7.566.586         | 1,30                         |
| 01/12/2053   | 5.400.000                | CAD     | 2.806.401          | 0,48                         | US (GOVT) 0,375 %        |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                    |                              | 15.01.27                 | 20.600.000               | USD     | 25.085.793        | 4,29                         |
|  |                          |         |                    |                              | US (GOVT) 0,5 %          |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                    |                              | 15.01.28                 | 22.400.000               | USD     | 26.509.043        | 4,53                         |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Inflation Linked Bond (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|--------------------|------------------------------|
| US (GOVT) 0,625 %<br>15.01.26   | 12.600.000               | USD     | 15.875.544         | 2,72                         |
| US (GOVT) 0,75 %<br>15.02.42  | 6.420.000                | USD     | 7.008.062          | 1,20                         |
| US (GOVT) 2,5 % 15.01.29  | 12.750.000               | USD     | 18.829.508         | 3,23                         |
| US TREASURY 2,125 %<br>15.02.41   | 1.900.000                | USD     | 2.714.525          | 0,46                         |
|   |                          |         | <b>150.699.627</b> | <b>25,80</b>                 |
| <b>SUMME ANLEIHEN</b>   |                          |         | <b>200.597.036</b> | <b>34,36</b>                 |
| <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN<br/>MARKT GEHANDELTEN ÜBERTRAGBAREN WERTPAPIERE</b> |                          |         | <b>200.597.036</b> | <b>34,36</b>                 |
| <b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>  |                          |         |                    |                              |
| <b>IRLAND</b>   |                          |         |                    |                              |
| HSBC US DOLLAR ESG  |                          |         |                    |                              |
| LIQUIDITY FUND Y INC  | 1.458.607                | USD     | 1.458.607          | 0,25                         |
|   |                          |         | <b>1.458.607</b>   | <b>0,25</b>                  |
| <b>SUMME ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>                                      |                          |         | <b>1.458.607</b>   | <b>0,25</b>                  |
| <b>SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>  |                          |         |                    |                              |
| <b>ANLEIHEN</b>   |                          |         |                    |                              |
| <b>KANADA</b>   |                          |         |                    |                              |
| CANADA (GOVT) 1,5 %<br>01/12/2044   | 3.250.000                | CAD     | 3.199.198          | 0,54                         |
| CANADA (GOVT) 2 %<br>01/12/2041   | 1.050.000                | CAD     | 1.153.639          | 0,20                         |
|   |                          |         | <b>4.352.837</b>   | <b>0,74</b>                  |
| <b>JAPAN</b>  |                          |         |                    |                              |
| JAPAN (GOVT) 0,005 %<br>10/03/2032  | 480.000.000              | JPY     | 3.607.290          | 0,62                         |
|   |                          |         | <b>3.607.290</b>   | <b>0,62</b>                  |
| <b>SUMME ANLEIHEN</b>   |                          |         | <b>7.960.127</b>   | <b>1,36</b>                  |
| <b>SUMME SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>                                      |                          |         | <b>7.960.127</b>   | <b>1,36</b>                  |
| <b>SUMME WERTPAPIERANLAGEN</b>  |                          |         | <b>582.430.639</b> | <b>99,76</b>                 |
| <b>SONSTIGES NETTOVERMÖGEN</b>  |                          |         | <b>1.398.345</b>   | <b>0,24</b>                  |
| <b>GESAMTNETTOVERMÖGEN</b>  |                          |         | <b>583.828.984</b> | <b>100,00</b>                |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Investment Grade Securitised Credit Bond  
Aufstellung der Wertpapiieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|--|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|
| <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>  |                          |         |                   |                              | POLARIS FRN 26.02.61                                 | 12.082.000               | GBP     | 15.285.670        | 0,79                         |
| <b>AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |                          |         |                   |                              | POLARIS FRN 26.02.61 (XS2765488676)                  | 19.924.000               | GBP     | 25.212.513        | 1,31                         |
| <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>                           |                          |         |                   |                              | PRECISE MORTGAGE FUNDING FRN 16.10.56                | 1.250.000                | GBP     | 1.576.175         | 0,08                         |
| <b>AUSTRALIEN</b>   |                          |         |                   |                              | STRATTON MORTGAGE FUNDING FRN 12.12.43               | 6.500.000                | GBP     | 4.692.348         | 0,24                         |
| APOLLO SERIES TRUST FRN 13.10.49                                  | 900.000                  | AUD     | 248.457           | 0,01                         | TOWER BRIDGE FUNDING FRN 20.12.63                    | 1.300.000                | GBP     | 700.324           | 0,04                         |
| APOLLO TRUST FRN 13.09.48   | 3.125.000                | AUD     | 729.156           | 0,04                         | TOWER BRIDGE FUNDING FRN 20.12.2063 (XS2432286461)   | 3.150.000                | GBP     | 3.937.157         | 0,20                         |
| FIRSTMAC MORTGAGE FUNDING TRUST FRN 17.11.50                      | 18.000.000               | AUD     | 3.051.705         | 0,16                         | TWIN BRIDGES FRN 12/03/2055                          | 4.406.000                | GBP     | 5.575.341         | 0,29                         |
| FIRSTMAC MORTGAGE FUNDING TRUST FRN 25.02.51                      | 5.000.000                | AUD     | 1.004.107         | 0,05                         | TWIN BRIDGES FRN 12/09/2055                          | 6.830.000                | GBP     | 8.541.132         | 0,44                         |
| LA TROBE FINANCIAL CAPITAL MARKET FRN 14.11.2053                  | 1.820.000                | AUD     | 531.745           | 0,03                         |  |                          |         | <b>90.105.633</b> | <b>4,68</b>                  |
| LION SERIES TRUST FRN 18.05.54                                    | 2.950.000                | AUD     | 1.400.480         | 0,07                         | <b>IRLAND</b>  |                          |         |                   |                              |
| NATIONAL RMBS TRUST FRN 24.08.49                                  | 5.300.000                | AUD     | 1.577.388         | 0,08                         | CARLYLE GLOBAL MARKET STRATEGIES FRN 10.11.2035      | 5.000.000                | EUR     | 5.332.070         | 0,28                         |
| PEPPER RESIDENTIAL SECURITIES TRUST FRN 18.11.60                  | 10.200.000               | AUD     | 878.568           | 0,05                         | CONTEGO CLO FRN 25.01.38                             | 4.250.000                | EUR     | 4.626.964         | 0,24                         |
| PEPPER RESIDENTIAL SECURITIES TRUST FRN 12.03.61                  | 4.000.000                | AUD     | 685.613           | 0,04                         | CONTEGO CLO FRN 25.01.2038 (XS2708631671)            | 5.000.000                | EUR     | 5.437.898         | 0,28                         |
| TRITON TRUST BOND SERIES FRN 12.04.2051                           | 12.300.000               | AUD     | 4.209.719         | 0,22                         | CONTEGO CLO FRN 25.01.2038 (XS2708631754)            | 7.850.000                | EUR     | 8.567.987         | 0,45                         |
|   |                          |         | <b>14.316.938</b> | <b>0,75</b>                  | FRN 17.06.32   | 2.000.000                | EUR     | 2.149.850         | 0,11                         |
| <b>FRANKREICH</b>   |                          |         |                   |                              | CVC CORDATUS LOAN FUND FRN 17.06.2032 (XS2078647497) | 4.000.000                | EUR     | 4.267.181         | 0,22                         |
| BPCE HOME LOANS FRN 31.10.57                                      | 8.100.000                | EUR     | 8.658.920         | 0,45                         | CVC CORDATUS LOAN FUND FRN 22.06.34                  | 7.000.000                | EUR     | 7.462.187         | 0,39                         |
| GINKGO PERSONAL LOANS FRN 23.09.44                                | 17.500.000               | EUR     | 18.970.584        | 0,99                         | DILLIONS PARK CLO FRN 15.10.34                       | 6.250.000                | EUR     | 6.701.549         | 0,35                         |
|   |                          |         | <b>27.629.504</b> | <b>1,44</b>                  | DILOSK RMBS FRN 20.12.60                             | 7.215.000                | EUR     | 7.783.477         | 0,40                         |
| <b>GROSSBRITANNIEN</b>  |                          |         |                   |                              | DRYDEN CLO FRN 15.04.2035                            | 3.035.000                | EUR     | 3.240.546         | 0,17                         |
| FINSBURY SQUARE FRN 16.12.67                                      | 1.350.000                | GBP     | 499.604           | 0,03                         | HARVEST CLO FRN 15.01.31                             | 2.500.000                | EUR     | 2.669.989         | 0,14                         |
| GEMGARTO PLC FRN 16.12.67   | 2.200.000                | GBP     | 2.778.872         | 0,14                         | INVESCO EURO FRN 15.07.31                            | 1.950.000                | EUR     | 2.049.581         | 0,11                         |
| GREAT HALL MORTGAGES FRN 18.06.39                                 | 1.000.000                | EUR     | 995.961           | 0,05                         | INVESCO EURO FRN 15.04.33                            | 4.000.000                | EUR     | 4.252.018         | 0,22                         |
| HOPS HILL FRN 27.05.2054  | 1.300.000                | GBP     | 1.643.810         | 0,09                         | INVESCO CLO FRN 15.07.36                             | 3.000.000                | EUR     | 3.279.302         | 0,17                         |
| LANEBROOK MTG TRANSACTION FRN 20.7.2058                           | 3.460.000                | GBP     | 4.338.487         | 0,23                         | LAST MILE LOGISTICS CMBS FRN 17.08.2033              | 9.400.000                | GBP     | 11.964.202        | 0,62                         |
| LONDON WALL MORTGAGE CAPITAL FRN 15.05.2051                       | 4.250.000                | GBP     | 5.366.133         | 0,28                         | LAST MILE LOGISTICS PAN EURO FINANCE FRN 17.08.2033  | 15.600.000               | EUR     | 16.290.154        | 0,85                         |
| MORTIMER BTL FRN 23.06.53   | 1.750.000                | GBP     | 1.509.855         | 0,08                         | ST PAUL'S CLO FRN 15.04.33                           | 4.500.000                | EUR     | 4.768.274         | 0,25                         |
| MORTIMER BTL FRN 23.06.2053 (XS2349428164)                        | 3.510.000                | GBP     | 4.411.811         | 0,23                         | ST PAUL'S CLO FRN 22.04.35                           | 1.000.000                | EUR     | 1.073.284         | 0,06                         |
| MORTIMER FRN 23.03.2054   | 2.400.000                | GBP     | 3.040.440         | 0,16                         |  |                          |         |                   |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Investment Grade Securitised Credit Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|--------------------|------------------------------|---|--------------------------|---------|--------------------|------------------------------|
| STARK FINANCING FRN<br>17.08.33                                     | 9.250.000                | GBP     | 11.762.184         | 0,61                         | <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN<br/>BÖRSE NOTIERTEN WERTPAPIERE<br/>WERTPAPIERE</b> |                          |         | <b>353.230.042</b> | <b>18,37</b>                 |
| STARK FINANCING FRN<br>17.08.2033 (XS2708124222)                    | 5.500.000                | GBP     | 6.966.634          | 0,36                         | <b>AN EINEM ANDEREM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE, ÜBERTRAGBARE<br/>WERTPAPIERE</b>    |                          |         |                    |                              |
| TAURUS CMBS FRN<br>20.02.30   | 5.000.000                | EUR     | 2.755.967          | 0,14                         | <b>ANLEIHEN</b>   |                          |         |                    |                              |
| WILTON PARK CLO FRN<br>25.11.36                                     | 8.000.000                | EUR     | 8.711.637          | 0,45                         | <b>USA</b>  |                          |         |                    |                              |
| WILTON PARK CLO FRN<br>25.11.2036 (XS2698482432)                    | 26.000.000               | EUR     | 28.264.473         | 1,48                         | AMERICAN TOWER TRUST<br>3,652 % 23.03.48  | 1.500.000                | USD     | 1.424.610          | 0,07                         |
| WILTON PARK CLO FRN<br>25.11.2036 (XS2698485294)                    | 4.500.000                | EUR     | 4.875.975          | 0,25                         | SBA TOWER TRUST 2,593 %<br>15.10.56   | 12.000.000               | USD     | 9.710.182          | 0,51                         |
|   |                          |         | <b>165.253.383</b> | <b>8,60</b>                  | <b>SUMME ANLEIHEN</b>   |                          |         | <b>11.134.792</b>  | <b>0,58</b>                  |
| <b>ITALIEN</b>  |                          |         |                    |                              | <b>11.134.792</b>   |                          |         | <b>11.134.792</b>  | <b>0,58</b>                  |
| TAURUS CMBS FRN<br>18/05/2030                                       | 4.000.000                | EUR     | 1.227.285          | 0,06                         | <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>   |                          |         |                    |                              |
|   |                          |         | <b>1.227.285</b>   | <b>0,06</b>                  | <b>AUSTRALIEN</b>   |                          |         |                    |                              |
| <b>JERSEY</b>   |                          |         |                    |                              | AFG FRN 10.03.2055  | 30.000.000               | AUD     | 16.374.123         | 0,85                         |
| APIDOS CLO FRN 25.04.35   | 2.000.000                | USD     | 2.019.608          | 0,10                         | AFG TRUST FRN 10.04.2052  | 3.450.000                | AUD     | 266.942            | 0,01                         |
| APIDOS CLO FRN 24.10.36   | 10.500.000               | USD     | 10.572.938         | 0,55                         | FIRSTMAC MORTGAGE FUNDING<br>TRUST FRN 17.01.51                                     | 10.800.000               | AUD     | 2.968.043          | 0,15                         |
|   |                          |         | <b>12.592.546</b>  | <b>0,65</b>                  | LA TROBE FINANCIAL CAPITAL<br>MARKET FRN 14.11.2053                                 | 6.000.000                | AUD     | 1.746.494          | 0,09                         |
| <b>LUXEMBURG</b>  |                          |         |                    |                              | MEDALLION TRUST FRN<br>19.01.56   | 60.000.000               | AUD     | 36.078.863         | 1,89                         |
| SC GERMANY COMPARTMENT<br>CONSUMER FRN 14.11.2035                   | 3.800.000                | EUR     | 2.775.128          | 0,14                         | PEPPER RESIDENTIAL SECURITIES<br>TRUST FRN 14.12.64                                 | 14.000.000               | AUD     | 6.425.381          | 0,33                         |
| SC GERMANY COMPARTMENT<br>CONSUMER FRN 14.11.2035<br>(XS2398388129) | 2.300.000                | EUR     | 1.661.457          | 0,09                         | SAPPHIRE XXVI SERIES<br>TRUST FRN 21.01.54  | 7.000.000                | AUD     | 1.863.124          | 0,10                         |
|   |                          |         | <b>4.436.585</b>   | <b>0,23</b>                  | TRUSTEE FOR LION SERIES<br>FRN 22.05.53   | 6.650.000                | AUD     | 4.426.687          | 0,23                         |
| <b>NIEDERLANDE</b>  |                          |         |                    |                              | <b>70.149.657</b>   |                          |         | <b>3,65</b>        |                              |
| DELPHINUS FRN 22.03.2102  | 7.500.000                | EUR     | 7.992.515          | 0,42                         | <b>CHINA</b>  |                          |         |                    |                              |
| GREEN STORM FRN<br>22.02.68   | 1.000.000                | EUR     | 1.088.897          | 0,06                         | ATRIUM FRN 23.01.2031   | 2.250.000                | USD     | 2.259.128          | 0,12                         |
| GREEN STORM FRN<br>22.05.69   | 3.500.000                | EUR     | 3.822.210          | 0,20                         | VENTURE CLO FRN<br>20.07.30   | 2.000.000                | USD     | 2.003.218          | 0,10                         |
| GREEN STORM FRN<br>22.02.70   | 4.000.000                | EUR     | 4.324.063          | 0,22                         | VENTURE XXVIII CLO FRN<br>20/07/2030  | 10.000.000               | USD     | 10.024.420         | 0,52                         |
| JUBILEE CLO FRN<br>15.06.32   | 5.000.000                | EUR     | 5.338.498          | 0,28                         | <b>14.286.766</b>   |                          |         | <b>0,74</b>        |                              |
| MAGOI FRN 27.07.2039  | 2.000.000                | EUR     | 437.068            | 0,02                         | <b>GROSSBRITANNIEN</b>  |                          |         |                    |                              |
|   |                          |         | <b>23.003.251</b>  | <b>1,20</b>                  | ELVET MORTGAGES FRN<br>22.08.65   | 10.150.000               | GBP     | 12.585.128         | 0,65                         |
| <b>USA</b>  |                          |         |                    |                              | EUROHOME UK MORTGAGES<br>FRN 15.09.44   | 3.500.000                | GBP     | 1.962.951          | 0,10                         |
| AMERICAN HOMES 4,407 %<br>17.04.52                                  | 1.800.000                | USD     | 1.769.162          | 0,09                         | GREAT HALL MORTGAGES<br>FRN 18.03.39  | 2.750.000                | EUR     | 2.743.441          | 0,14                         |
| APIDOS CLO FRN 21.04.2035   | 9.000.000                | USD     | 9.017.145          | 0,47                         | POLARIS FRN 23.12.2058  | 3.000.000                | GBP     | 3.780.033          | 0,20                         |
| BROADGATE FINANCING<br>5,098 % 05.04.35                             | 1.515.000                | GBP     | 1.562.979          | 0,08                         | POLARIS FRN 23.09.59  | 18.989.000               | GBP     | 23.287.914         | 1,22                         |
| CONNECTICUT AVENUE SECURITIES<br>TRUST FRN 25.03.42                 | 3.200.000                | USD     | 1.945.384          | 0,10                         | POLARIS FRN 23.09.59<br>(XS2673975897)  | 3.824.000                | GBP     | 4.949.316          | 0,26                         |
| GREAT HALL MORTGAGES FRN<br>18.03.39                                | 300.000                  | GBP     | 370.247            | 0,02                         |   |                          |         |                    |                              |
|   |                          |         | <b>14.664.917</b>  | <b>0,76</b>                  |   |                          |         |                    |                              |
| <b>SUMME FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>                       |                          |         | <b>353.230.042</b> | <b>18,37</b>                 |   |                          |         |                    |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Investment Grade Securitised Credit Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|--|--------------------------|---------|--------------------|------------------------------|
| TOWER BRIDGE FUNDING<br>FRN 20.12.63                        | 9.056.000                | GBP     | 11.376.808        | 0,59                         | JUBILEE CLO FRN<br>20/11/2031                                  | 2.300.000                | EUR     | 2.494.549          | 0,13                         |
| TOWER BRIDGE FUNDING<br>FRN 21.07.64                        | 4.000.000                | GBP     | 5.056.482         | 0,26                         | JUBILEE FRN 21.01.2038   | 5.000.000                | EUR     | 5.417.810          | 0,28                         |
|   |                          |         | <b>65.742.073</b> | <b>3,42</b>                  | JUBILEE FRN 21.01.2038<br>(XS2666004291)                       | 15.000.000               | EUR     | 16.248.289         | 0,85                         |
| <b>IRLAND</b>   |                          |         |                   |                              | JUBILEE FRN 21.01.2038<br>(XS2666004374)                       | 10.000.000               | EUR     | 10.865.694         | 0,56                         |
| AGORA SECURITIES FRN<br>17.08.31                            | 6.800.000                | GBP     | 8.515.448         | 0,44                         | LAST MILE LOGISTICS FRN<br>17.08.26                            | 3.500.000                | EUR     | 3.617.146          | 0,19                         |
| BERG FINANCE FRN<br>22.07.33                                | 7.300.000                | EUR     | 1.298.909         | 0,07                         | LAST MILE LOGISTICS FRN<br>17.08.2026 (XS2356454913)           | 3.200.000                | EUR     | 3.273.342          | 0,17                         |
| BERG FINANCE FRN<br>22.07.2033 (XS2331952270)               | 6.000.000                | EUR     | 929.477           | 0,05                         | LAST MILE LOGISTICS FRN<br>17.08.33                            | 2.727.000                | GBP     | 3.465.380          | 0,18                         |
| BERG FINANCE FRN<br>22.07.2033 (XS2331952601)               | 4.500.000                | EUR     | 828.056           | 0,04                         | LAST MILE SECURITIES<br>FRN 17.08.31                           | 7.059.000                | EUR     | 7.474.281          | 0,39                         |
| BRUEGEL FRN 22.05.2031                                      | 7.400.000                | EUR     | 7.213.324         | 0,38                         | LAST MILE SECURITIES FRN<br>17.08.2031 (XS2320420792)          | 5.552.000                | EUR     | 5.957.457          | 0,31                         |
| BRUEGEL FRN 22.05.2031<br>(XS2346732972)                    | 2.000.000                | EUR     | 1.916.515         | 0,10                         | LAST MILE SECURITIES FRN<br>17.08.2031 (XS2320420875)          | 2.800.000                | EUR     | 2.960.793          | 0,15                         |
| CABINTEELY PARK CLO FRN<br>15.08.34                         | 13.000.000               | EUR     | 13.899.106        | 0,72                         | LAST MILE SECURITIES FRN<br>17.08.2031 (XS2320421501)          | 5.000.000                | EUR     | 5.322.359          | 0,28                         |
| CVC CORDATUS LOAN FUND<br>FRN 15.05.37                      | 7.600.000                | EUR     | 8.207.999         | 0,43                         | PENTA CLO FRN 15.01.37   | 20.000.000               | EUR     | 21.754.607         | 1,14                         |
| CVC CORDATUS LOAN FUND FRN<br>15.05.2037 (XS2774947449)     | 11.000.000               | EUR     | 11.879.999        | 0,62                         | PENTA CLO FRN<br>15.01.2037 (XS2708719096)                     | 8.750.000                | EUR     | 9.568.282          | 0,50                         |
| DRYDEN CLO FRN 18.10.34                                     | 5.350.000                | EUR     | 5.704.373         | 0,30                         | PENTA CLO FRN<br>15.01.2037 (XS2708719849)                     | 3.300.000                | EUR     | 3.589.469          | 0,19                         |
| DRYDEN CLO FRN 15.04.2035                                   | 3.675.000                | EUR     | 3.914.865         | 0,20                         | TAURUS DAC FRN 17.05.31  | 3.253.000                | GBP     | 4.016.159          | 0,21                         |
| DRYDEN FRN 20.10.2035                                       | 7.600.000                | USD     | 7.613.042         | 0,40                         | TAURUS FRN 17.05.2031  | 11.909.000               | GBP     | 14.868.643         | 0,77                         |
| ELM PARK FRN 15.04.2034                                     | 10.000.000               | EUR     | 10.656.869        | 0,55                         | TAURUS FRN 17.05.2031<br>(XS2303819176)                        | 3.616.000                | GBP     | 4.491.074          | 0,23                         |
| ELM PARK FRN 15.04.2034<br>(XS2325161946)                   | 10.000.000               | EUR     | 10.721.799        | 0,56                         | TAURUS FRN 22.12.30  | 6.000.000                | EUR     | 5.882.633          | 0,31                         |
| FINANCE IRELAND RMBS<br>FRN 24.06.61                        | 3.300.000                | EUR     | 3.559.933         | 0,19                         | VIRIDIS EUROPEAN LOAN<br>CONDUIT FRN 22.07.29                  | 3.000.000                | GBP     | 3.621.829          | 0,19                         |
| FINANCE IRELAND RMBS FRN<br>24.06.2061 (XS2345323328)       | 5.000.000                | EUR     | 5.400.015         | 0,28                         | VIRIDIS EUROPEAN LOAN CONDUIT FRN<br>22.07.2029 (XS2352587229) | 2.900.000                | GBP     | 3.333.544          | 0,17                         |
| FROST CMBS DAC FRN<br>22.11.26                              | 5.200.000                | EUR     | 5.169.749         | 0,27                         | VITA SCIENTIA DAC FRN<br>27.08.25                              | 7.500.000                | EUR     | 7.981.133          | 0,41                         |
| FROST CMBS DAC FRN<br>22.11.2026 (XS2402428697)             | 7.500.000                | EUR     | 7.570.968         | 0,39                         |  |                          |         | <b>304.124.312</b> | <b>15,81</b>                 |
| GLENBEIGH 2 ISSUER DAC<br>FRN 24.06.50                      | 7.000.000                | EUR     | 4.465.787         | 0,23                         |  |                          |         |                    |                              |
| HARVEST CLO FRN<br>20.10.32                                 | 2.400.000                | EUR     | 2.551.601         | 0,13                         | <b>ITALIEN</b>   |                          |         |                    |                              |
| HAUS EUROPEAN LOAN<br>CONDUIT FRN 30.07.2051                | 7.850.000                | EUR     | 7.967.017         | 0,41                         | ERNA FRN 25.07.2031<br>(IT0005373029)                          | 6.500.000                | EUR     | 3.216.148          | 0,17                         |
| HAUS EUROPEAN LOAN CONDUIT FRN<br>30.07.2051 (XS2372978572) | 1.200.000                | EUR     | 1.206.227         | 0,06                         |  |                          |         | <b>3.216.148</b>   | <b>0,17</b>                  |
| INVESCO CLO FRN<br>15.04.34                                 | 6.000.000                | USD     | 6.000.186         | 0,31                         | <b>JERSEY</b>  |                          |         |                    |                              |
| INVESCO CLO FRN<br>15.04.2034 (US46090XAG60)                | 5.500.000                | USD     | 5.443.042         | 0,28                         | NEUBERGER BERMAN LOAN<br>ADVISERS FRN 24.10.32                 | 6.000.000                | USD     | 6.010.079          | 0,31                         |
| INVESCO CLO FRN<br>22.10.36                                 | 6.000.000                | EUR     | 6.558.926         | 0,34                         | NEUBERGER BERMAN LOAN FRN<br>24.10.2032 (US64135WAE30)         | 4.750.000                | USD     | 4.764.639          | 0,25                         |
| INVESCO CLO FRN<br>22.10.2036 (XS2693769536)                | 8.000.000                | EUR     | 8.726.607         | 0,45                         | PIKES PEAK CLO FRN<br>20.10.36                                 | 5.000.000                | USD     | 5.017.261          | 0,26                         |
|   |                          |         |                   |                              | PIKES PEAK CLO FRN<br>20.10.2036 (US720922AA14)                | 7.500.000                | USD     | 7.545.036          | 0,40                         |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Investment Grade Securitised Credit Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung                                       | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert   | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|--|--------------------------|---------|------------|------------------------------|
| PIKES PEAK CLO FRN<br>20.10.2036 (US270922AE36)    | 6.000.000                | USD     | 6.038.597         | 0,31                         | 15.04.2031 (US03767VAN82)                                | 8.550.000                | USD     | 8.527.077  | 0,44                         |
|  |                          |         | <b>29.375.612</b> | <b>1,53</b>                  | APIDOS CLO XXXIX FRN<br>21.04.35                         | 12.500.000               | USD     | 12.375.588 | 0,64                         |
| <b>NIEDERLANDE</b>                                 |                          |         |                   |                              | APIDOS CLO XXXVII FRN<br>22.10.34                        | 7.750.000                | USD     | 7.750.983  | 0,40                         |
| DRYDEN CLO FRN 18.10.34                            | 2.500.000                | EUR     | 2.672.023         | 0,14                         | ARES XLV CLO FRN<br>15.10.30                             | 2.500.000                | USD     | 2.504.703  | 0,13                         |
| GREEN LION FRN 23.07.2065                          | 2.500.000                | EUR     | 2.709.229         | 0,14                         | AVENUE OF THE AMERICAS<br>5.6896 % 13.10.37              | 8.000.000                | USD     | 7.938.338  | 0,41                         |
| JUBILEE CLO FRN<br>15.04.35                        | 4.000.000                | EUR     | 4.237.825         | 0,22                         | BAIN CAPITAL CREDIT CLO<br>FRN 18.04.34                  | 5.000.000                | USD     | 4.958.075  | 0,26                         |
| JUBILEE CLO FRN<br>15.04.2035 (XS2308743520)       | 4.000.000                | EUR     | 4.267.644         | 0,22                         | BAIN CAPITAL CREDIT CLO<br>FRN 19.04.34                  | 10.000.000               | USD     | 9.982.640  | 0,52                         |
|  |                          |         | <b>13.886.721</b> | <b>0,72</b>                  | BAIN CAPITAL CREDIT CLO FRN<br>23.10.34                  | 8.500.000                | USD     | 8.500.102  | 0,44                         |
| <b>USA</b>   |                          |         |                   |                              | BAIN CAPITAL CREDIT CLO FRN<br>23.10.2034 (US05684CAL90) | 6.365.000                | USD     | 6.369.481  | 0,33                         |
| 280 PARK AVENUE<br>MORTGAGE FRN 15.09.2034         | 7.235.000                | USD     | 6.999.268         | 0,36                         | BAIN CAPITAL CREDIT CLO<br>FRN 16.07.35                  | 10.000.000               | USD     | 10.004.460 | 0,52                         |
| 280 PARK AVENUE MORTGAGE<br>TRUST FRN 15.09.34     | 8.000.000                | USD     | 7.502.903         | 0,39                         | BAIN CAPITAL CREDIT FRN<br>23.10.34                      | 7.500.000                | USD     | 7.492.800  | 0,39                         |
| AGL CLO FRN 21.01.37                               | 5.000.000                | USD     | 5.061.536         | 0,26                         | BAIN CAPITAL CREDIT FRN<br>23.10.2034 (US05682EAC75)     | 8.000.000                | USD     | 8.000.096  | 0,42                         |
| AGL CLO FRN 21.01.37<br>(US00120WAA27)             | 25.000.000               | USD     | 25.145.174        | 1,32                         | BAIN CAPITAL CREDIT FRN<br>23.10.2034 (US05682EAG89)     | 6.000.000                | USD     | 5.984.304  | 0,31                         |
| AGL CLO FRN 21.01.37<br>(US00120WAE49)             | 8.000.000                | USD     | 8.027.592         | 0,42                         | BAMLL COMMERCIAL MORTGAGE<br>3,7157 % VRN 14.04.33       | 3.500.000                | USD     | 3.344.978  | 0,17                         |
| AGL CLO FRN 21.04.2037                             | 4.000.000                | USD     | 4.001.283         | 0,21                         | BAMLL MORTGAGE TRUST<br>3,218 % 14.04.33                 | 16.000.000               | USD     | 15.414.668 | 0,80                         |
| AGL CLO FRN 21.04.2037<br>(US00119BAD55)           | 2.000.000                | USD     | 2.005.854         | 0,10                         | BARCLAYS COMMERCIAL<br>MORTGAGE FRN 15.03.37             | 5.017.000                | USD     | 4.675.067  | 0,24                         |
| AGL CLO FRN 21.04.2037<br>(US00119BAC72)           | 3.000.000                | USD     | 3.008.942         | 0,16                         | BAYSWATER PARK CLO FRN<br>20.01.37                       | 35.000.000               | USD     | 35.348.284 | 1,84                         |
| ALBA FRN 25.11.2042                                | 926.000                  | GBP     | 471.486           | 0,02                         | BAYSWATER PARK CLO FRN<br>20.01.2037 (US072929AE27)      | 10.000.000               | USD     | 10.069.547 | 0,52                         |
| ALIGNED DATA CENTERS<br>ISSUER 1,937 % 15.08.46    | 13.000.000               | USD     | 11.854.600        | 0,62                         | BAYSWATER PARK CLO FRN<br>20.01.2037 (US072929AG74)      | 5.000.000                | USD     | 5.060.861  | 0,26                         |
| ALLEGANY PARK CLO FRN<br>20.01.35                  | 2.000.000                | USD     | 1.994.832         | 0,10                         | BBCMS 2018 TALL MORTGAGE<br>TRUST FRN 15.03.37           | 7.580.000                | USD     | 6.990.611  | 0,36                         |
| ALLEGANY PARK CLO FRN<br>20.01.2035 (US017154AQ81) | 1.500.000                | USD     | 1.485.191         | 0,08                         | BF NYT MORTGAGE TRUST FRN<br>15.11.2035 (US62954PAJ930)  | 4.400.000                | USD     | 3.881.431  | 0,20                         |
| AMERICAN HOMES 4 RENT<br>4,596 % 17.12.36          | 1.970.000                | USD     | 1.948.965         | 0,10                         | BOYCE PARK CLO FRN<br>21.04.35                           | 10.250.000               | USD     | 10.289.070 | 0,53                         |
| APIDOS CLO FRN 18.10.31                            | 10.850.000               | USD     | 10.792.495        | 0,56                         | BX TRUST 5,76 % 13.10.2027                               | 17.165.455               | USD     | 17.265.381 | 0,90                         |
| APIDOS CLO FRN<br>18.10.2031 (US03768CAG42)        | 3.000.000                | USD     | 2.999.028         | 0,16                         | BX TRUST 6,3 % 13.10.2027                                | 3.000.000                | USD     | 2.829.721  | 0,15                         |
| APIDOS CLO FRN<br>18.10.2031 (US03768CAJ80)        | 5.000.000                | USD     | 4.994.515         | 0,26                         | BX TRUST 6,79 % 13.10.2027                               | 1.000.000                | USD     | 917.899    | 0,05                         |
| APIDOS CLO FRN 15.01.33                            | 3.000.000                | USD     | 3.003.669         | 0,16                         | BX TRUST FRN 25.11.2028                                  | 4.000.000                | USD     | 2.793.776  | 0,15                         |
| APIDOS CLO FRN<br>20.01.33                         | 5.000.000                | USD     | 4.999.995         | 0,26                         | BX TRUST FRN 25.11.2028<br>(US05608FAG63)                | 4.500.000                | USD     | 3.143.863  | 0,16                         |
| APIDOS CLO FRN 22.10.34                            | 10.200.000               | USD     | 10.193.976        | 0,53                         | BX TRUST FRN 15.11.32                                    | 11.000.000               | USD     | 2.087.254  | 0,11                         |
| APIDOS CLO XXVII FRN<br>17.07.30                   | 10.000.000               | USD     | 9.988.070         | 0,52                         | BXP TRUST 3,379 %<br>13.06.39                            | 11.096.000               | USD     | 10.332.423 | 0,54                         |
| APIDOS CLO XXVII FRN<br>17.07.2030 (US03767JAK16)  | 9.000.000                | USD     | 8.977.293         | 0,47                         | CAMB COMMERCIAL FRN<br>15.12.37                          | 9.110.000                | USD     | 9.115.007  | 0,47                         |
| APIDOS CLO XXXI FRN<br>15.04.31                    | 18.000.000               | USD     | 18.035.657        | 0,94                         |  |                          |         |            |                              |
| APIDOS CLO XXXI FRN<br>15.04.2031 (US03767VAL27)   | 8.300.000                | USD     | 8.294.198         | 0,43                         |  |                          |         |            |                              |
| APIDOS CLO XXXI FRN                                |                          |         |                   |                              |  |                          |         |            |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Investment Grade Securitised Credit Bond (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung                                       | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert   | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert   | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--------------------------|---------|------------|------------------------------|---|--------------------------|---------|------------|------------------------------|
| CAMB COMMERCIAL MORTGAGE TRUST FRN 15.12.37        | 16.310.000               | USD     | 16.311.467 | 0,85                         | HPS LOAN MANAGEMENT FRN 25.01.2034 (US40437WU27)              | 5.000.000                | USD     | 4.921.055  | 0,26                         |
| CIFC FUNDING FRN 17/10/2031                        | 3.250.000                | USD     | 3.255.905  | 0,17                         | HPS LOAN MANAGEMENT FRN 22.01.35                              | 7.500.000                | USD     | 7.407.098  | 0,39                         |
| CIFC FUNDING FRN 20/04/2032                        | 9.750.000                | USD     | 9.756.854  | 0,51                         | HUDSON YARDS MORTGAGE 2,835 % 10.08.38                        | 6.250.000                | USD     | 5.850.470  | 0,30                         |
| CIFC FUNDING FRN 20.04.2032 (US12553DAN75)         | 3.000.000                | USD     | 2.980.836  | 0,15                         | HUDSON YARDS MORTGAGE 3,38 % 10.07.39                         | 15.000.000               | USD     | 13.470.347 | 0,70                         |
| CIMNL 2,09 % 20.07.51                              | 2.400.000                | USD     | 1.982.524  | 0,10                         | HUDSON YARDS MORTGAGE 3,38 % VRN 10.07.39                     | 1.500.000                | USD     | 1.323.152  | 0,07                         |
| COMM 2018 HOME MORTGAGE TRUST 3,815 % VRN 10.04.33 | 2.000.000                | USD     | 1.837.255  | 0,10                         | IMT TRUST 3,6132 % VRN 15.06.34                               | 1.000.000                | USD     | 990.290    | 0,05                         |
| COMM MORTGAGE TRUST 3,815 % VRN 10.04.33           | 6.700.000                | USD     | 5.885.557  | 0,31                         | INDEPENDENCE PLAZA TRUST 3,763 % 10.07.35                     | 11.587.500               | USD     | 11.108.114 | 0,58                         |
| COMMERCIAL MORTGAGE TRUST 1,802 % 10.01.38         | 2.500.000                | USD     | 2.178.555  | 0,11                         | INDEPENDENCE PLAZA TRUST 3,911 % 10.07.35                     | 5.000.000                | USD     | 4.748.394  | 0,25                         |
| COMMERCIAL MORTGAGE TRUST 2,056 % VRN 10.01.38     | 1.845.000                | USD     | 1.591.007  | 0,08                         | INVCO FRN 15.07.2034  | 9.500.000                | USD     | 9.500.314  | 0,49                         |
| COMMERCIAL MORTGAGE TRUST 2,321 % VRN 10.01.38     | 1.000.000                | USD     | 844.055    | 0,04                         | INVCO FRN 15.07.2034 (US46149MAD83)                           | 9.500.000                | USD     | 9.428.076  | 0,49                         |
| CONNECTICUT AVENUE SECURITIES TRUST FRN 25.06.43   | 5.000.000                | USD     | 4.269.222  | 0,22                         | INVITATION HOMES TRUST FRN 17.01.38                           | 3.513.000                | USD     | 3.522.091  | 0,18                         |
| CONNECTICUT AVENUE SECURITIES TRUST FRN 25.09.43   | 4.000.000                | USD     | 3.625.399  | 0,19                         | MADISON PARK FUNDING FRN 15.07.30                             | 5.000.000                | USD     | 4.983.635  | 0,26                         |
| COOK PARK FRN 17.04.2030                           | 11.500.000               | USD     | 11.429.356 | 0,59                         | MADISON PARK FUNDING FRN 18.10.30                             | 9.300.000                | USD     | 9.305.980  | 0,48                         |
| CORE MORTGAGE TRUST FRN 15.12.31                   | 2.500.000                | USD     | 1.907.643  | 0,10                         | MORGAN STANLEY CAPITAL TRUST 2,8098 % 09.11.31                | 7.500.000                | USD     | 5.821.485  | 0,30                         |
| CORE TRUST FRN 15.12.2031                          | 5.630.000                | USD     | 1.022.866  | 0,05                         | MORGAN STANLEY CAPITAL TRUST 2,8098 % 09.11.31 (US61773PAE16) | 7.500.000                | USD     | 6.055.913  | 0,31                         |
| DBCG MORTGAGE TRUST FRN 15.06.34                   | 5.220.000                | USD     | 5.233.310  | 0,27                         | MORGAN STANLEY CAPITAL TRUST FRN 15.12.38                     | 5.000.000                | USD     | 4.782.990  | 0,25                         |
| DBGS BIOD MORTGAGE TRUST FRN 15.05.35              | 5.500.000                | USD     | 5.014.185  | 0,26                         | MORGAN STANLEY CAPITAL TRUST FRN 15.12.2038 (US61772WAG24)    | 4.800.000                | USD     | 4.481.874  | 0,23                         |
| DBGS MORTGAGE TRUST FRN 15.05.35                   | 18.096.000               | USD     | 16.439.846 | 0,85                         | NAVIENT STUDENT LOAN TRUST 3,5 % 15.12.44                     | 1.000.000                | USD     | 912.873    | 0,05                         |
| DBGS MORTGAGE TRUST FRN 15.05.2035 (US23306GAE70)  | 4.787.000                | USD     | 4.340.956  | 0,23                         | NEUBERGER BERMAN CLO FRN 15.01.30                             | 3.000.000                | USD     | 2.975.982  | 0,15                         |
| FLEXENTIAL ISSUER 3,25 % 27.11.51                  | 3.750.000                | USD     | 3.408.434  | 0,18                         | NEUBERGER BERMAN LOAN ADVISERS FRN 26.04.36                   | 6.500.000                | USD     | 6.465.142  | 0,34                         |
| FREDDIE MAC STACR REMIC TRUST FRN 25.01.42         | 20.730.000               | USD     | 14.011.500 | 0,73                         | NEUBERGER BERMAN LOAN ADVISERS FRN 26.04.36 (US64134GAS84)    | 7.500.000                | USD     | 7.502.038  | 0,39                         |
| FREDDIE MAC STRUCTURED AGENCY FRN 25.02.2042       | 27.925.000               | USD     | 14.209.877 | 0,74                         | NYC COMMERCIAL MORTGAGE TRUST 3,142 % 10.04.31                | 10.412.000               | USD     | 6.894.810  | 0,36                         |
| GILBERT PARK CLO FRN 15.10.30                      | 3.300.000                | USD     | 3.294.700  | 0,17                         | NYC COMMERCIAL MORTGAGE TRUST 3,2055 % 10.04.31               | 10.000.000               | USD     | 7.768.574  | 0,40                         |
| HERO FUNDING TRUST 4,07 % 20.09.48                 | 1.000.000                | USD     | 192.463    | 0,01                         | NYT MORTGAGE TRUST FRN 15.11.35                               | 7.355.000                | USD     | 6.915.975  | 0,36                         |
| HERO FUNDING TRUST 4,67 % 20.09.48                 | 2.000.000                | USD     | 475.631    | 0,02                         | NYT MORTGAGE TRUST FRN 15.11.2035 (US62954PAA84)              | 4.000.000                | USD     | 3.902.485  | 0,20                         |
| HOME PARTNERS OF AMERICA 2,402 % 17.12.26          | 4.000.000                | USD     | 3.507.242  | 0,18                         | OCTAGON INVESTMENT PARTNERS FRN 15.07.2030                    | 10.000.000               | USD     | 9.953.670  | 0,52                         |
| HPS LOAN MANAGEMENT FRN 25.01.34                   | 9.150.000                | USD     | 9.076.846  | 0,47                         |   |                          |         |            |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Investment Grade Securitised Credit Bond (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert   | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert             | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--------------------------|---------|------------|------------------------------|---|--------------------------|---------|----------------------|------------------------------|
| OCTAGON INVESTMENT PARTNERS FRN<br>15.07.2030 (US67590YAQ35) | 3.000.000                | USD     | 3.005.703  | 0,16                         | VOYA CLO FRN 18.10.2031   | 4.000.000                | USD     | 3.965.840            | 0,21                         |
| PIKES PEAK CLO 5<br>FRN 20.04.33                             | 4.000.000                | USD     | 4.018.564  | 0,21                         | VENTURE CLO FRN<br>20.10.34   | 2.500.000                | USD     | 2.494.598            | 0,13                         |
| PROGRESS RESIDENTIAL<br>1,51 % 17.10.38                      | 1.387.000                | USD     | 1.253.661  | 0,07                         | VENTURE CLO FRN<br>20.07.35   | 5.000.000                | USD     | 5.053.380            | 0,26                         |
| PROGRESS RESIDENTIAL<br>1,808 % 17.05.38                     | 2.500.000                | USD     | 2.305.161  | 0,12                         | WHETSTONE PARK CLO FRN<br>20.01.35  | 12.500.000               | USD     | 12.500.000           | 0,65                         |
| PROGRESS RESIDENTIAL<br>2,039 % 17.05.38                     | 7.000.000                | USD     | 6.460.546  | 0,34                         | WHETSTONE PARK CLO FRN<br>20.01.2035 (US96329YAC12)                                 | 5.500.000                | USD     | 5.497.355            | 0,29                         |
| PROGRESS RESIDENTIAL<br>2,262 % 17.11.40                     | 11.500.000               | USD     | 10.050.625 | 0,52                         | WHETSTONE PARK CLO FRN<br>20.01.2035 (US96329YAG26)                                 | 3.000.000                | USD     | 2.959.455            | 0,15                         |
| PROGRESS RESIDENTIAL<br>2,722 % 17.12.40                     | 14.685.000               | USD     | 12.842.052 | 0,67                         |   |                          |         | <b>877.350.942</b>   | <b>45,61</b>                 |
| PROGRESS RESIDENTIAL<br>3,107 % 17.02.41                     | 4.337.000                | USD     | 3.895.473  | 0,20                         | <b>SUMME FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>                                       |                          |         | <b>1.378.132.231</b> | <b>71,65</b>                 |
| PROGRESS RESIDENTIAL<br>4,5 % 17.10.28                       | 1.000.000                | USD     | 951.098    | 0,05                         | <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN<br/>MARKT GEHANDELTEN ÜBERTRAGBAREN WERTPAPIERE</b> |                          |         | <b>1.389.267.023</b> | <b>72,23</b>                 |
| PROGRESS RESIDENTIAL 4,5 %<br>17.10.2028 (US74331GAA76)      | 2.500.000                | USD     | 2.437.860  | 0,13                         | <b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>  |                          |         |                      |                              |
| PROGRESS RESIDENTIAL 4,5 %<br>17.10.2028 (US74331GAC33)      | 1.000.000                | USD     | 956.692    | 0,05                         | <b>IRLAND</b>   |                          |         |                      |                              |
| PROGRESS RESIDENTIAL<br>4,888 % 17.05.41                     | 1.900.000                | USD     | 1.832.803  | 0,10                         | HSBC US DOLLAR ESG<br>LIQUIDITY FUND Y INC  | 58.186.980               | USD     | 58.186.980           | 3,02                         |
| PROGRESS RESIDENTIAL<br>TRUST 1,524 % 17.07.38               | 2.833.710                | USD     | 2.589.974  | 0,13                         |   |                          |         | <b>58.186.980</b>    | <b>3,02</b>                  |
| PROGRESS RESIDENTIAL<br>TRUST 1,658 % 16.07.26               | 3.500.000                | USD     | 3.190.642  | 0,17                         | <b>SUMME ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>                                      |                          |         | <b>58.186.980</b>    | <b>3,02</b>                  |
| PROGRESS RESIDENTIAL<br>TRUST 1,808 % 16.07.26               | 1.750.000                | USD     | 1.595.390  | 0,08                         | <b>SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>  |                          |         |                      |                              |
| PROGRESS RESIDENTIAL<br>TRUST 1,855 % 17.07.38               | 4.250.000                | USD     | 3.879.556  | 0,20                         | <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>   |                          |         |                      |                              |
| PROGRESS RESIDENTIAL<br>TRUST 2,362 % 17.11.40               | 3.250.000                | USD     | 2.840.273  | 0,15                         | <b>AUSTRALIEN</b>   |                          |         |                      |                              |
| SABEY DATA CENTER<br>ISSUER 1,881 % 20.06.46                 | 6.000.000                | USD     | 5.422.514  | 0,28                         | FIRSTMAC MORTGAGE FUNDING TRUST<br>FRN 12.06.55                                     | 8.000.000                | AUD     | 5.224.132            | 0,27                         |
| SLM PRIVATE CREDIT STUDENT<br>TRUST FRN 15.09.33             | 5.747.000                | USD     | 4.574.683  | 0,24                         | LA TROBE FINANCIAL CAPITAL<br>MARKET FRN 14.07.54                                   | 5.000.000                | AUD     | 2.748.502            | 0,14                         |
| SLM STUDENT LOAN TRUST<br>FRN 15.12.38                       | 22.456.000               | USD     | 9.933.047  | 0,52                         | LA TROBE FINANCIAL CAPITAL<br>MARKET FRN 14.05.55                                   | 6.000.000                | AUD     | 3.942.556            | 0,20                         |
| SLM PRIVATE LOAN TRUST<br>FRN 15.06.39                       | 69.795.000               | USD     | 21.647.741 | 1,13                         | LIBERTY SERIES FRN<br>25.06.54  | 2.500.000                | AUD     | 1.664.452            | 0,09                         |
| SLM PRIVATE LOAN FRN<br>16.12.41                             | 9.891.000                | USD     | 2.967.886  | 0,15                         | PEPPER RESIDENTIAL SECURITIES<br>TRUST FRN 16.07.65                                 | 14.000.000               | AUD     | 9.161.557            | 0,49                         |
| SMB PRIVATE EDUCATION<br>LOAN FRN 17.02.2032                 | 1.000.000                | USD     | 74.171     | 0,00                         | PROGRESS TRUST FRN<br>12/07/2054  | 5.000.000                | AUD     | 3.321.411            | 0,17                         |
| VANTAGE DATA CENTERS<br>1,645 % 15.09.45                     | 9.150.000                | USD     | 8.574.396  | 0,45                         | RESIMAC PREMIER SERIES<br>FRN 07.02.52  | 6.500.000                | AUD     | 4.265.187            | 0,22                         |
| VANTAGE DATA CENTERS<br>1,992 % 15.09.45                     | 1.000.000                | USD     | 883.170    | 0,05                         | RESIMAC BASTILLE TRUST<br>SERIES FRN 13.09.55                                       | 10.000.000               | AUD     | 6.524.000            | 0,34                         |
| VANTAGE DATA CENTERS<br>2,165 % 15.10.46                     | 13.000.000               | USD     | 11.885.305 | 0,62                         | TRITON BOND TRUST FRN<br>09/08/2054   | 3.500.000                | AUD     | 2.320.382            | 0,12                         |
|  |                          |         |            |                              | TRITON BOND TRUST FRN<br>11/02/2056   | 12.500.000               | AUD     | 8.154.804            | 0,42                         |
|  |                          |         |            |                              |   |                          |         | <b>47.326.983</b>    | <b>2,46</b>                  |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Investment Grade Securitised Credit Bond (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert             | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|----------------------|------------------------------|
| <b>GROSSBRITANNIEN</b>                                    |                          |         |                      |                              |
| FINSBURY SQUARE FRN<br>16/12/2067                         | 5.500.000                | GBP     | 6.899.021            | 0,36                         |
| TOWER BRIDGE FUNDING<br>FRN 20.11.63                      | 3.200.000                | GBP     | 4.040.398            | 0,21                         |
| TOWER BRIDGE FUNDING FRN<br>20.11.2063 (XS2360876622)     | 1.700.000                | GBP     | 2.144.692            | 0,11                         |
|   |                          |         | <b>13.084.111</b>    | <b>0,68</b>                  |
| <b>IRLAND</b>   |                          |         |                      |                              |
| ATOM MORTGAGE<br>SECURITIES FRN 22.07.31                  | 5.348.000                | GBP     | 5.079.964            | 0,26                         |
| ATOM MORTGAGE SECURITIES FRN<br>22.07.2031 (XS2373055826) | 5.600.000                | GBP     | 5.303.676            | 0,28                         |
| DILLIONS PARK FRN<br>15.10.34                             | 5.000.000                | EUR     | 5.314.804            | 0,28                         |
| DILLIONS PARK FRN<br>15.10.2034 (XS2388462934)            | 7.000.000                | EUR     | 7.431.849            | 0,38                         |
| TAURUS CMBS FRN<br>17.08.2031 (XS2368104613)              | 7.429.000                | GBP     | 5.537.598            | 0,29                         |
|   |                          |         | <b>28.667.891</b>    | <b>1,49</b>                  |
| <b>NIEDERLANDE</b>  |                          |         |                      |                              |
| DRYDEN CLO FRN<br>15/04/2034                              | 9.880.000                | EUR     | 10.449.587           | 0,54                         |
|   |                          |         | <b>10.449.587</b>    | <b>0,54</b>                  |
| <b>USA</b>  |                          |         |                      |                              |
| BXP TRUST 3,4248 % VRN<br>13.06.39                        | 5.540.000                | USD     | 5.034.488            | 0,26                         |
| BXP TRUST 3,539 % VRN<br>13.06.39                         | 3.000.000                | USD     | 2.761.729            | 0,14                         |
| DBC MORTGAGE TRUST<br>2017 FRN 15.06.2034                 | 8.725.000                | USD     | 8.725.174            | 0,46                         |
| DBC MORTGAGE TRUST FRN<br>15.06.2034 (US233062AJ76)       | 1.250.000                | USD     | 1.250.025            | 0,06                         |
| PIKES PEAK CLO FRN<br>15.07.34                            | 10.000.000               | USD     | 10.078.970           | 0,53                         |
| PROGRESS RESIDENTIAL<br>4,451 % 20.07.39                  | 1.000.000                | USD     | 975.999              | 0,05                         |
| VERDE CLO FRN<br>15/04/2032                               | 6.150.000                | USD     | 6.154.539            | 0,32                         |
|   |                          |         | <b>34.980.924</b>    | <b>1,82</b>                  |
| <b>SUMME FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>             |                          |         | <b>134.509.496</b>   | <b>6,99</b>                  |
| <b>SUMME SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>            |                          |         | <b>134.509.496</b>   | <b>6,99</b>                  |
| <b>SUMME WERTPAPIERANLAGEN</b>                            |                          |         | <b>1.935.193.541</b> | <b>100,61</b>                |
| <b>SONSTIGE NETTOVERBINDLICHKEITEN</b>                    |                          |         | <b>(11.655.730)</b>  | <b>(0,61)</b>                |
| <b>GESAMTNETTOVERMÖGEN</b>                                |                          |         | <b>1.923.537.811</b> | <b>100,00</b>                |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Lower Carbon Bond

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung                | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung   | Kurswert  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|------------------|------------------------------|-----------------------------|--------------------------|-----------|-----------|------------------------------|
| <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>  |                          |         |                  |                              | SAMPO 2,5 % VRN 03.09.2052  |                          |           |           |                              |
| <b>AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |                          |         |                  |                              | SAMPO 3,375 % VRN           |                          |           |           |                              |
| <b>ANLEIHEN</b>   |                          |         |                  |                              | 23.05.49                    |                          |           |           |                              |
|   |                          |         |                  |                              | <b>FRANKREICH</b>           |                          |           |           |                              |
| <b>AUSTRALIEN</b>   |                          |         |                  |                              | ALD 4 % 05.07.27            |                          |           |           |                              |
| BHP BILLITON FINANCE  |                          |         |                  |                              | 1.500.000                   | EUR                      |           | 1.634.887 | 0,66                         |
| USA 5,5 % 08.09.53  | 1.000.000                | USD     | 1.036.623        | 0,41                         | AXA 6,375 % VRN PERP        | 1.000.000                | EUR       | 1.122.955 | 0,45                         |
| SYDNEY AIRPORT FINANCE  |                          |         |                  |                              | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT |                          |           |           |                              |
| 1,75 % 26.04.28   | 1.000.000                | EUR     | 1.012.689        | 0,41                         | MUTUEL 0,1 % 08.10.27       | 1.500.000                | EUR       | 1.450.778 | 0,58                         |
|   |                          |         | <b>2.049.312</b> | <b>0,82</b>                  | BNP PARIBAS 2,5 % VRN       | 1.500.000                | EUR       | 1.539.086 | 0,62                         |
| <b>ÖSTERREICH</b>   |                          |         |                  |                              | BNP PARIBAS 5,894 % VRN     |                          |           |           |                              |
| ERSTE GROUP BANK 4 %  |                          |         |                  |                              | 05/12/2034                  | 305.000                  | USD       | 319.380   | 0,13                         |
| VRN 07.06.33  | 1.000.000                | EUR     | 1.064.016        | 0,43                         | BNP PARIBAS 8 % VRN PERP    | 295.000                  | USD       | 301.478   | 0,12                         |
|   |                          |         | <b>1.064.016</b> | <b>0,43</b>                  | CAPGEMINI 1,125 %           | 1.500.000                | EUR       | 1.432.426 | 0,58                         |
| <b>BELGIEN</b>  |                          |         |                  |                              | 23.06.30                    |                          |           |           |                              |
| BELFIUS BANK 3,75 %   |                          |         |                  |                              | CREDIT AGRICOLE 1,625 %     |                          |           |           |                              |
| 22.01.29  | 1.000.000                | EUR     | 1.078.110        | 0,43                         | VRN 05.06.30                | 1.600.000                | EUR       | 1.674.670 | 0,67                         |
| ELIA TRANSMISSION   |                          |         |                  |                              | CREDIT AGRICOLE ASSURANCES  |                          |           |           |                              |
| BELGIUM 3,75 % 16.01.2036   | 1.000.000                | EUR     | 1.093.210        | 0,44                         | 4,5 % VRN PERP              | 600.000                  | EUR       | 649.281   | 0,26                         |
| KBC GROUP 1,625 % VRN   |                          |         |                  |                              | CREDIT AGRICOLE ASSURANCES  |                          |           |           |                              |
| 18.09.29  | 400.000                  | EUR     | 426.450          | 0,17                         | 5,875 % 25.10.33            | 1.000.000                | EUR       | 1.213.499 | 0,49                         |
| KBC GROUP 2,875 % VRN   |                          |         |                  |                              | CREDIT MUTUEL ARKEA         |                          |           |           |                              |
| 29.06.25  | 500.000                  | EUR     | 538.627          | 0,22                         | 3,875 % 22.05.28            | 1.000.000                | EUR       | 1.099.650 | 0,44                         |
|   |                          |         | <b>3.136.397</b> | <b>1,26</b>                  | DANONE 3,47 % 22.05.31      | 900.000                  | EUR       | 987.677   | 0,40                         |
| <b>KANADA</b>   |                          |         |                  |                              | ENGIE 3,5 % 27.09.29        |                          |           |           |                              |
| ALIMENTATION COUCHE   |                          |         |                  |                              | 800.000                     | EUR                      |           | 872.824   | 0,35                         |
| 3,647 % 12.05.31  | 1.500.000                | EUR     | 1.626.699        | 0,65                         | ESSILORLUXOTTICA 0,5 %      |                          |           |           |                              |
| CANADIAN IMPERIAL BANK OF COM-                                    |                          |         |                  |                              | 05/06/2028                  | 1.000.000                | EUR       | 977.973   | 0,39                         |
| MERCE 5,001 % 28.04.28  | 200.000                  | USD     | 199.662          | 0,08                         | FONCIERE DES REGIONS        |                          |           |           |                              |
| ROYAL BANK OF CANADA  |                          |         |                  |                              | 1,875 % 20.05.26            |                          |           |           |                              |
| 2,125 % 26.04.29  | 1.000.000                | EUR     | 1.015.839        | 0,41                         | 1.000.000                   | EUR                      | 1.039.414 | 0,42      |                              |
| ROYAL BANK OF CANADA  |                          |         |                  |                              | GECINA 1,625 % 14.03.30     |                          |           |           |                              |
| 4,875 % 19.01.27  | 1.500.000                | USD     | 1.497.838        | 0,60                         | 1.000.000                   | EUR                      | 980.296   | 0,39      |                              |
| ROYAL BANK OF CANADA  |                          |         |                  |                              | KERING 3,25 % 27.02.29      |                          |           |           |                              |
| 5,15 % 01.02.34   | 235.000                  | USD     | 235.625          | 0,09                         | 1.500.000                   | EUR                      | 1.623.557 | 0,65      |                              |
| WASTE CONNECTIONS 2,2 %   |                          |         |                  |                              | LOREAL 2,875 % 19.05.28     |                          |           |           |                              |
| 15.01.32  | 970.000                  | USD     | 796.507          | 0,32                         | 1.200.000                   | EUR                      | 1.291.189 | 0,52      |                              |
| WASTE CONNECTIONS 3,2 %   |                          |         |                  |                              | LVMH MOET HENNESSY 3,5 %    |                          |           |           |                              |
| 01/06/2032  | 330.000                  | USD     | 291.185          | 0,12                         | 07/09/2033                  | 1.000.000                | EUR       | 1.115.710 | 0,45                         |
| WASTE CONNECTIONS 5 %   |                          |         |                  |                              | PERNOD RICARD 0,5 %         |                          |           |           |                              |
| 01/03/2034  | 1.450.000                | USD     | 1.438.192        | 0,58                         | 24.10.27                    | 1.000.000                | EUR       | 986.924   | 0,40                         |
|   |                          |         | <b>7.101.547</b> | <b>2,85</b>                  | RCI BANQUE 3,875 %          |                          |           |           |                              |
| <b>DÄNEMARK</b>   |                          |         |                  |                              | 12/01/2029                  |                          |           |           |                              |
| JYSKE BANK 5,125 % VRN  |                          |         |                  |                              | 500.000                     | EUR                      |           | 540.590   | 0,22                         |
| 01/05/2035  | 1.000.000                | EUR     | 1.104.532        | 0,44                         | RCI BANQUE 4,75 %           |                          |           |           |                              |
|   |                          |         | <b>1.104.532</b> | <b>0,44</b>                  | 06/07/2027                  | 500.000                  | EUR       | 555.989   | 0,22                         |
| <b>FINNLAND</b>   |                          |         |                  |                              | SCHNEIDER ELECTRIC          |                          |           |           |                              |
| NORDEA BANK 4,875 % VRN   |                          |         |                  |                              | 3,25 % 10.10.35             |                          |           |           |                              |
| 23.02.34  | 446.000                  | EUR     | 498.207          | 0,20                         | 2.000.000                   | EUR                      | 2.164.808 | 0,87      |                              |
|   |                          |         |                  |                              | 1.100.000                   | EUR                      | 1.170.938 | 0,47      |                              |
|   |                          |         |                  |                              | WPP FINANCE 4,125 %         |                          |           |           |                              |
|   |                          |         |                  |                              | 30.05.28                    |                          |           |           |                              |
|   |                          |         |                  |                              | 1.400.000                   |                          |           |           |                              |
|   |                          |         |                  |                              | EUR                         |                          |           |           |                              |
|   |                          |         |                  |                              | 1.544.224                   |                          |           |           |                              |
|   |                          |         |                  |                              | <b>28.290.203</b>           |                          |           |           |                              |
|   |                          |         |                  |                              | <b>11,37</b>                |                          |           |           |                              |
| <b>DEUTSCHLAND</b>  |                          |         |                  |                              | ALLIANZ 2,121 % VRN         |                          |           |           |                              |
|   |                          |         |                  |                              | 08/07/2050                  |                          |           |           |                              |
|   |                          |         |                  |                              | 1.000.000                   |                          |           |           |                              |
|   |                          |         |                  |                              | EUR                         |                          |           |           |                              |
|   |                          |         |                  |                              | 963.412                     |                          |           |           |                              |
|   |                          |         |                  |                              | 0,39                        |                          |           |           |                              |
|   |                          |         |                  |                              | ALLIANZ 2,625 % VRN PERP    |                          |           |           |                              |
|   |                          |         |                  |                              | 1.200.000                   |                          |           |           |                              |
|   |                          |         |                  |                              | EUR                         |                          |           |           |                              |
|   |                          |         |                  |                              | 1.022.299                   |                          |           |           |                              |
|   |                          |         |                  |                              | 0,41                        |                          |           |           |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Lower Carbon Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--------------------------|---------|------------------|------------------------------|--|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|
| DEUTSCHE BANK AG NEW YORK<br>7,146 % VRN 13.07.27    | 1.000.000                | USD     | 1.028.394        | 0,41                         | VODAFONE GROUP<br>1,625 % 24.11.30                         | 1.400.000                | EUR     | 1.359.365         | 0,55                         |
| DEUTSCHE BOERSE 1,25 %<br>VRN 16.06.47               | 1.100.000                | EUR     | 1.091.315        | 0,44                         | VODAFONE GROUP 4,875 %<br>19.06.49                         | 500.000                  | USD     | 448.586           | 0,18                         |
| EUROGRID 1,113 %<br>15.05.32                         | 1.600.000                | EUR     | 1.442.339        | 0,58                         |  |                          |         | <b>16.352.726</b> | <b>6,57</b>                  |
| FRESENIUS MEDICAL CARE<br>1,5 % 29.05.30             | 800.000                  | EUR     | 758.512          | 0,30                         | <b>IRLAND</b>  |                          |         |                   |                              |
| INFINEON TECHNOLOGIES<br>3,375 % 26.02.27            | 1.000.000                | EUR     | 1.083.407        | 0,44                         | AERCAP IRELAND CAPITAL<br>4,45 % 01.10.25                  | 1.150.000                | USD     | 1.132.976         | 0,46                         |
| MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGSGE 1 % VRN 26.05.2042   | 1.000.000                | EUR     | 864.889          | 0,35                         | AERCAP IRELAND CAPITAL<br>4,625 % 15.10.27                 | 795.000                  | USD     | 776.034           | 0,31                         |
|  |                          |         | <b>8.254.567</b> | <b>3,32</b>                  | AIB GROUP 5,25 % VRN<br>23.10.31                           | 1.200.000                | EUR     | 1.400.768         | 0,56                         |
| <b>GROSSBRITANNIEN</b>                               |                          |         |                  |                              | BANK OF IRELAND 1,375 %<br>VRN 11.08.31                    | 1.500.000                | EUR     | 1.516.588         | 0,61                         |
| BARCLAYS 5,262 % VRN<br>29.01.34                     | 1.400.000                | EUR     | 1.635.145        | 0,66                         |  |                          |         | <b>4.826.366</b>  | <b>1,94</b>                  |
| BARCLAYS 5,304 %<br>09/08/2026                       | 1.000.000                | USD     | 995.489          | 0,40                         | <b>ITALIEN</b>   |                          |         |                   |                              |
| BARCLAYS 5,69 % VRN<br>12/03/2030                    | 200.000                  | USD     | 201.118          | 0,08                         | ASSICURAZIONI GENERALI<br>5,272 % 12.09.33                 | 2.000.000                | EUR     | 2.299.284         | 0,93                         |
| BARCLAYS 6,692 % VRN<br>13.09.34                     | 335.000                  | USD     | 357.657          | 0,14                         | ENEL 1,375 % VRN PERP<br>UNICREDIT 0,8 % VRN<br>05/07/2029 | 1.600.000                | EUR     | 1.546.926         | 0,62                         |
| BARCLAYS 7,325 % VRN<br>02/11/2026                   | 780.000                  | USD     | 799.353          | 0,32                         |  |                          |         | <b>5.001.019</b>  | <b>2,01</b>                  |
| BP CAPITAL MARKETS<br>4,375 % VRN PERP               | 167.000                  | USD     | 164.128          | 0,07                         | <b>JAPAN</b>   |                          |         |                   |                              |
| COMPASS GROUP 3,25 %<br>06/02/2031                   | 500.000                  | EUR     | 540.224          | 0,22                         | NTT FINANCE 3,359 %<br>12/03/2031                          | 1.000.000                | EUR     | 1.087.685         | 0,44                         |
| NATIONAL GRID 0,25 %<br>01/09/2028                   | 1.500.000                | EUR     | 1.411.327        | 0,57                         |  |                          |         | <b>1.087.685</b>  | <b>0,44</b>                  |
| NATIONAL GRID 5,418 %<br>11/01/2034                  | 820.000                  | USD     | 816.175          | 0,33                         | <b>LUXEMBURG</b>   |                          |         |                   |                              |
| NATIONWIDE BUILDING SOCIETY<br>6,557 % VRN 18.10.27  | 370.000                  | USD     | 379.877          | 0,15                         | CNH INDUSTRIAL FINANCE<br>EUROPE 1,625 % 03.07.29          | 900.000                  | EUR     | 887.796           | 0,36                         |
| NATWEST MARKETS 1,6 %<br>29.09.26                    | 640.000                  | USD     | 585.789          | 0,24                         | EUROCLEAR INVESTMENTS<br>2,625 % VRN 11.04.48              | 1.500.000                | EUR     | 1.519.589         | 0,62                         |
| NATWEST GROUP 1,642 %<br>VRN 14.06.27                | 655.000                  | USD     | 602.665          | 0,24                         | NESTLE FINANCE INTERNATIONAL<br>3 % 23.01.31               | 1.000.000                | EUR     | 1.079.956         | 0,43                         |
| NATWEST GROUP 6,475 %<br>VRN 01.06.34                | 560.000                  | USD     | 569.747          | 0,23                         | NESTLE FINANCE INTERNATIONAL<br>3,75 % 14.11.35            | 600.000                  | EUR     | 681.690           | 0,27                         |
| PRUDENTIAL FUNDING ASIA<br>3,625 % 24.03.32          | 945.000                  | USD     | 854.117          | 0,34                         | SEGRO CAPITAL 1,875 %<br>23.03.30                          | 1.000.000                | EUR     | 975.846           | 0,39                         |
| ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP<br>3,754 % VRN 01.11.29 | 200.000                  | USD     | 196.896          | 0,08                         |  |                          |         | <b>5.144.877</b>  | <b>2,07</b>                  |
| SSE PLC 4 % 05.09.2031                               | 1.500.000                | EUR     | 1.677.404        | 0,66                         | <b>NIEDERLANDE</b>   |                          |         |                   |                              |
| STANDARD CHARTERED<br>1,822 % 23.11.25               | 1.305.000                | USD     | 1.269.750        | 0,51                         | ABN AMRO BANK 6,339 %<br>VRN 18.09.27                      | 1.000.000                | USD     | 1.017.698         | 0,41                         |
| STANDARD CHARTERED<br>6,097 % VRN 11.01.35           | 910.000                  | USD     | 936.434          | 0,38                         | AERCAP HOLDINGS 5,875 %<br>VRN 10.10.79                    | 375.000                  | USD     | 373.005           | 0,15                         |
| STANDARD CHARTERED<br>7,018 % 08.02.30               | 520.000                  | USD     | 551.480          | 0,22                         | ARGENTUM NETHERLANDS<br>2,75 % VRN 19.02.49                | 800.000                  | EUR     | 819.280           | 0,33                         |
|  |                          |         |                  |                              | ASR NEDERLAND 3,625 %<br>12/12/2028                        | 138.000                  | EUR     | 149.445           | 0,06                         |
|  |                          |         |                  |                              | ASR NEDERLAND 7 % VRN<br>07/12/2043                        | 1.000.000                | EUR     | 1.249.189         | 0,50                         |
|  |                          |         |                  |                              | COMPASS GROUP FINANCE<br>NETHERLANDS 3 % 08.03.30          | 1.000.000                | EUR     | 1.068.852         | 0,43                         |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Lower Carbon Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapiieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|--|--------------------------|---------|------------------|------------------------------|
| EDP FINANCE 1,875 %<br>21.09.29  | 1.000.000                | EUR     | 997.446           | 0,40                         | UBS GROUP 2,746 %<br>11/02/2033                      | 620.000                  | USD     | 508.109          | 0,20                         |
| ING GROEP 6,114 % VRN<br>11/09/2034  | 1.000.000                | USD     | 1.040.326         | 0,42                         | UBS GROUP 5,699 % VRN<br>08/02/2035                  | 295.000                  | USD     | 297.107          | 0,12                         |
| ING GROEP FRN 1 %<br>13.11.30  | 600.000                  | EUR     | 615.280           | 0,25                         |  |                          |         | <b>1.830.679</b> | <b>0,74</b>                  |
| KONINKLIJKE AHOLD<br>DELHAIZE 0,375 % 18.03.30                                       | 1.000.000                | EUR     | 919.004           | 0,37                         | <b>USA</b>   |                          |         |                  |                              |
| NN GROUP 6,375 % VRN PERP<br>SIEMENS FINANCIERINGSMAAT-<br>SCHAPPI 2,75 % 09.09.2030 | 698.000                  | EUR     | 758.371           | 0,30                         | ALEXANDRIA REAL ESTATE<br>EQUITIES 5,15 % 15.04.2053 | 110.000                  | USD     | 101.413          | 0,04                         |
| TENNET HOLDING 1,375 %<br>05/06/2028   | 900.000                  | EUR     | 957.216           | 0,38                         | ANHEUSERBUSCH 4,7 %<br>01/02/2036                    | 335.000                  | USD     | 326.068          | 0,13                         |
| UNILEVER FINANCE NETHERLANDS<br>3,5 % 23.02.35                                       | 800.000                  | EUR     | 820.043           | 0,33                         | ANHEUSERBUSCH 4,9 %<br>01/02/2046                    | 165.000                  | USD     | 157.304          | 0,06                         |
| UNIVERSAL MUSIC GROUP<br>4 % 13.06.31  | 1.100.000                | EUR     | 1.218.463         | 0,49                         | ANHEUSERBUSCH INBEV<br>WORLDWIDE 5 % 15.06.2034      | 840.000                  | USD     | 844.794          | 0,34                         |
| VESTEDA FINANCE 1,5 %<br>24.05.27  | 1.200.000                | EUR     | 1.213.503         | 0,49                         | ASHTEAD CAPITAL 5,95 %<br>15.10.33                   | 235.000                  | USD     | 237.909          | 0,10                         |
|  |                          |         | <b>14.335.234</b> | <b>5,76</b>                  | ASTRAZENECA FINANCE<br>4,8 % 26.02.27                | 1.000.000                | USD     | 1.000.418        | 0,40                         |
| <b>NORWEGEN</b>  |                          |         |                   |                              | ATT 2,05 % 19.05.32                                  | 1.200.000                | EUR     | 1.170.469        | 0,47                         |
| DNB BANK 5 % VRN<br>13.09.33   | 1.500.000                | EUR     | 1.671.929         | 0,67                         | BANK OF AMERICA 5,468 %<br>VRN 23.01.35              | 575.000                  | USD     | 580.062          | 0,23                         |
|  |                          |         | <b>1.671.929</b>  | <b>0,67</b>                  | BANK OF AMERICA 5,872 %<br>VRN 15.09.34              | 1.065.000                | USD     | 1.105.953        | 0,44                         |
| <b>SPANIEN</b>   |                          |         |                   |                              | BRISTOLMYERS SQUIBB<br>5,9 % 15.11.33                | 650.000                  | USD     | 695.068          | 0,28                         |
| BANCO SANTANDER 0,3 %<br>04/10/2026  | 500.000                  | EUR     | 500.407           | 0,20                         | CISCO SYSTEMS 4,8 %<br>26.02.27                      | 460.000                  | USD     | 461.110          | 0,19                         |
| BANCO SANTANDER 5 % VRN<br>22.04.34  | 500.000                  | EUR     | 551.401           | 0,22                         | CSX 5,2 % 15.11.33                                   | 1.000.000                | USD     | 1.019.026        | 0,41                         |
| BANCO SANTANDER 5,75 %<br>VRN 23.08.33   | 1.000.000                | EUR     | 1.135.886         | 0,46                         | CVS HEALTH 5,875 %<br>01/06/2053                     | 150.000                  | USD     | 153.106          | 0,06                         |
| BANCO SANTANDER 6,607 %<br>07/11/2028  | 400.000                  | USD     | 423.431           | 0,17                         | ELI LILLY 4,7 % 09.02.34                             | 1.125.000                | USD     | 1.120.556        | 0,45                         |
| BANCO SANTANDER 6,921 %<br>08/08/2033  | 200.000                  | USD     | 209.550           | 0,08                         | ELI LILLY 5 % 09.02.2054                             | 485.000                  | USD     | 483.910          | 0,19                         |
| BANKINTER 1,25 % VRN<br>23.12.32   | 1.200.000                | EUR     | 1.173.155         | 0,47                         | EXELON 5,15 % 15.03.29                               | 265.000                  | USD     | 265.762          | 0,11                         |
| CAIXABANK 0,75 % VRN<br>10/07/2026   | 1.500.000                | EUR     | 1.559.346         | 0,63                         | GENERAL MOTORS<br>FINANCIAL 5,75 % 08.02.31          | 145.000                  | USD     | 146.699          | 0,06                         |
| INMOBILIARIA COLONIAL<br>SOCIMI 2 % 17.04.26   | 1.000.000                | EUR     | 1.044.359         | 0,42                         | GENERAL MOTORS<br>FINANCIAL 5,8 % 23.06.28           | 500.000                  | USD     | 510.203          | 0,21                         |
| MAPFRE 4,125 % VRN<br>07/09/2048   | 600.000                  | EUR     | 638.164           | 0,26                         | GENERAL MOTORS<br>FINANCIAL 5,8 % 07.01.29           | 675.000                  | USD     | 687.795          | 0,28                         |
|  |                          |         | <b>7.235.699</b>  | <b>2,91</b>                  | GILEAD SCIENCES 5,25 %<br>15.10.33                   | 780.000                  | USD     | 797.582          | 0,32                         |
| <b>SCHWEDEN</b>  |                          |         |                   |                              | GOLDMAN SACHS GROUP<br>4,223 % 01.05.29              | 135.000                  | USD     | 130.085          | 0,05                         |
| NORDEA BANK 0,625 % VRN<br>18.08.31  | 1.000.000                | EUR     | 1.000.361         | 0,40                         | HUNTINGTON BANCSHARES<br>5,709 % VRN 02.02.35        | 1.745.000                | USD     | 1.741.946        | 0,70                         |
| TELIA 2,125 % 20.02.34   | 1.200.000                | EUR     | 1.173.426         | 0,47                         | JOHN DEERE CAPITAL<br>5,15 % 08.09.26                | 1.000.000                | USD     | 1.006.804        | 0,40                         |
|  |                          |         | <b>2.173.787</b>  | <b>0,87</b>                  | JPMORGAN CHASE 3,761 %<br>VRN 21.03.34               | 937.000                  | EUR     | 1.026.304        | 0,41                         |
| <b>SCHWEIZ</b>   |                          |         |                   |                              | JPMORGAN CHASE 4,6 % VRN<br>PERP                     | 2.430.000                | USD     | 2.397.401        | 0,96                         |
| UBS AGLONDON 5,65 %<br>11/09/2028  | 1.000.000                | USD     | 1.025.463         | 0,42                         |  |                          |         |                  |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Lower Carbon Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapiieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|--------------------|------------------------------|--|--------------------------|---------|------------------|------------------------------|
| JPMORGAN CHASE 5,336 %<br>VRN 23.01.35  | 345.000                  | USD     | 346.798            | 0,14                         | <b>KANADA</b>  |                          |         |                  |                              |
| MORGAN STANLEY 5,424 %<br>VRN 21.07.34  | 750.000                  | USD     | 754.021            | 0,30                         | ROYAL BANK OF CANADA<br>5,2 % 01.08.28                 | 500.000                  | USD     | 505.831          | 0,21                         |
| MORGAN STANLEY 5,466 %<br>VRN 18.01.35  | 260.000                  | USD     | 263.144            | 0,11                         | WASTE CONNECTIONS 4,2 %<br>15.01.33                    | 430.000                  | USD     | 405.272          | 0,16                         |
| MORGAN STANLEY 5,942 %<br>VRN 07.02.39  | 450.000                  | USD     | 447.963            | 0,18                         |  |                          |         | <b>911.103</b>   | <b>0,37</b>                  |
| MOTOROLA SOLUTIONS 5 %<br>15.04.29  | 275.000                  | USD     | 273.904            | 0,11                         | <b>FRANKREICH</b>                                      |                          |         |                  |                              |
| MOTOROLA SOLUTIONS 5,4 %<br>15.04.34  | 240.000                  | USD     | 239.811            | 0,10                         | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT<br>MUTUEL 5,088 % 23.01.27 | 445.000                  | USD     | 445.067          | 0,18                         |
| PNC FINANCIAL SERVICES<br>5,3 % VRN 21.01.28  | 550.000                  | USD     | 550.927            | 0,22                         | BNP PARIBAS 1,323 % VRN<br>13.01.27                    | 470.000                  | USD     | 437.334          | 0,18                         |
| PRUDENTIAL FINANCIAL<br>6,5 % VRN 15.03.54  | 1.000.000                | USD     | 1.017.273          | 0,41                         | BNP PARIBAS 2,219 % VRN<br>09/06/2026                  | 565.000                  | USD     | 543.342          | 0,22                         |
| SYNCHRONY BANK 5,4 %<br>22.08.25  | 335.000                  | USD     | 332.224            | 0,13                         | BNP PARIBAS 2,824 %<br>26.01.41                        | 300.000                  | USD     | 205.341          | 0,08                         |
| TMOBILE 5,05 % 15.07.2033   | 490.000                  | USD     | 485.373            | 0,20                         | BNP PARIBAS CARDIF<br>4,032 % VRN PERP                 | 1.000.000                | EUR     | 1.071.333        | 0,42                         |
| TMOBILE 5,5 % 15.01.55  | 115.000                  | USD     | 115.114            | 0,05                         | CREDIT AGRICOLE 1,907 %<br>VRN 16.06.26                | 935.000                  | USD     | 894.361          | 0,36                         |
| TMOBILE US 5,75 %<br>15.01.34   | 175.000                  | USD     | 182.637            | 0,07                         | CREDIT AGRICOLE 5,134 %<br>11/03/2027                  | 2.000.000                | USD     | 2.002.911        | 0,80                         |
| TOYOTA MOTOR CREDIT<br>3,85 % 24.07.30  | 1.000.000                | EUR     | 1.110.312          | 0,45                         | CREDIT AGRICOLE 5,335 %<br>VRN 10.01.30                | 840.000                  | USD     | 838.743          | 0,34                         |
| UNITED STATES TREASURY<br>NOTE BOND 4,25 % 15.03.2027                               | 2.100.000                | USD     | 2.091.879          | 0,84                         | CREDIT AGRICOLE 6,316 %<br>VRN 03.10.29                | 300.000                  | USD     | 311.231          | 0,13                         |
| UNITEDHEALTH GROUP<br>5,375 % 15.04.54  | 780.000                  | USD     | 795.170            | 0,32                         |  |                          |         | <b>6.749.663</b> | <b>2,71</b>                  |
| US (GOVT) 4 % 31.01.29  | 155.000                  | USD     | 153.565            | 0,06                         | <b>DEUTSCHLAND</b>                                     |                          |         |                  |                              |
| US (GOVT) 4,125 % 15.08.53  | 1.992.000                | USD     | 1.921.035          | 0,77                         | DEUTSCHE BANK 5 % VRN<br>05/09/2030                    | 1.600.000                | EUR     | 1.796.832        | 0,72                         |
| US (GOVT) 4,75 % 15.11.2053   | 2.430.000                | USD     | 2.601.997          | 1,06                         |  |                          |         | <b>1.796.832</b> | <b>0,72</b>                  |
| US BANCORP 5,678 % VRN<br>23.01.35  | 300.000                  | USD     | 303.576            | 0,12                         | <b>IRLAND</b>  |                          |         |                  |                              |
| US BANCORP 5,775 % VRN<br>12/06/2029  | 370.000                  | USD     | 377.194            | 0,15                         | AERCAP IRELAND CAPITAL<br>3,5 % 15.01.25               | 345.000                  | USD     | 339.589          | 0,14                         |
| VERIZON COMMUNICATIONS<br>5,5 % 23.02.54  | 1.000.000                | USD     | 1.013.330          | 0,41                         | AIB GROUP 6,608 % VRN<br>13.09.29                      | 230.000                  | USD     | 239.946          | 0,10                         |
| WASTE MANAGEMENT 4,875 %<br>15.02.29  | 945.000                  | USD     | 955.090            | 0,38                         | SMURFIT KAPPA TREASURY<br>5,2 % 15.01.30               | 285.000                  | USD     | 284.796          | 0,11                         |
|   |                          |         | <b>34.500.084</b>  | <b>13,87</b>                 | SMURFIT KAPPA TREASURY<br>5,777 % 03.04.54             | 200.000                  | USD     | 200.000          | 0,08                         |
| <b>SUMME ANLEIHEN</b>   |                          |         | <b>147.342.816</b> | <b>59,22</b>                 |  |                          |         | <b>1.064.331</b> | <b>0,43</b>                  |
| <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN<br/>BÖRSE NOTIERTEN WERTPAPIERE<br/>WERTPAPIERE</b> |                          |         | <b>147.342.816</b> | <b>59,22</b>                 | <b>ITALIEN</b>   |                          |         |                  |                              |
| <b>AN EINEM ANDEREM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE, ÜBERTRAGBARE<br/>WERTPAPIERE</b>    |                          |         |                    |                              | INTESA SANPAOLO 4,198 %<br>01/06/2032                  | 385.000                  | USD     | 322.717          | 0,13                         |
| <b>ANLEIHEN</b>   |                          |         |                    |                              | INTESA SANPAOLO 7,2 %<br>28.11.33                      | 230.000                  | USD     | 248.720          | 0,10                         |
| <b>BELGIEN</b>  |                          |         |                    |                              | INTESA SANPAOLO 7,8 %<br>28.11.53                      | 335.000                  | USD     | 380.565          | 0,15                         |
| KBC GROUP 6,324 % VRN<br>21.09.34   | 365.000                  | USD     | 383.758            | 0,15                         |  |                          |         | <b>952.002</b>   | <b>0,38</b>                  |
|   |                          |         | <b>383.758</b>     | <b>0,15</b>                  | <b>NIEDERLANDE</b>                                     |                          |         |                  |                              |
|   |                          |         |                    |                              | ABB FINANCE 0,625 %<br>31.03.24                        | 1.000.000                | EUR     | 1.080.000        | 0,43                         |
|   |                          |         |                    |                              | COOPERATIEVE RABOBANK<br>5,041 % 05.03.27              | 1.200.000                | USD     | 1.204.763        | 0,49                         |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Lower Carbon Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung                                      | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|------------------|------------------------------|--|--------------------------|---------|-----------|------------------------------|
| ENEL FINANCE INTERNATIONAL<br>5,5 % 15.06.52      | 290.000                  | USD     | 272.893          | 0,11                         | BANK OF AMERICA 4,571 %<br>VRN 27.04.33                | 650.000                  | USD     | 618.266   | 0,25                         |
| FERROVIAL 4,375 %<br>13.09.30                     | 1.800.000                | EUR     | 2.026.254        | 0,82                         | BMW US CAPITAL 4,9 %<br>02/04/2029                     | 245.000                  | USD     | 245.022   | 0,10                         |
| IBERDROLA INTERNATIONAL<br>3,25 % VRN PERP        | 1.000.000                | EUR     | 1.069.750        | 0,43                         | BRISTOLMYERS SQUIBB<br>5,2 % 22.02.34                  | 285.000                  | USD     | 290.005   | 0,12                         |
| ING GROEP 2,125 % VRN<br>26.05.31                 | 800.000                  | EUR     | 829.822          | 0,33                         | BROADCOM 3,187 %<br>15.11.36                           | 921.000                  | USD     | 734.665   | 0,30                         |
|   |                          |         | <b>6.483.482</b> | <b>2,61</b>                  | BROADCOM 3,5 % 15.02.41                                | 160.000                  | USD     | 124.568   | 0,05                         |
| <b>NEUSEELAND</b>                                 |                          |         |                  |                              | BROADCOM 4,15 % 15.11.30                               | 560.000                  | USD     | 530.451   | 0,21                         |
| BANK OF NEW ZEALAND<br>5,076 % 30.01.29           | 925.000                  | USD     | 925.097          | 0,37                         | BROADCOM 4,15 % 15.04.32                               | 425.000                  | USD     | 394.846   | 0,16                         |
|   |                          |         | <b>925.097</b>   | <b>0,37</b>                  | BROADCOM 4,926 %<br>15.05.37                           | 757.000                  | USD     | 720.256   | 0,29                         |
| <b>SPANIEN</b>                                    |                          |         |                  |                              | CAPITAL ONE FINANCIAL<br>5,817 % VRN 01.02.34          | 235.000                  | USD     | 235.149   | 0,09                         |
| CAIXABANK 5,673 % VRN<br>15.03.30                 | 430.000                  | USD     | 430.102          | 0,17                         | CHARTER COMMUNICATIONS OPE-<br>RATING 5,125 % 01.07.49 | 1.000.000                | USD     | 777.616   | 0,31                         |
| CAIXABANK 6,037 % VRN<br>15.06.35                 | 430.000                  | USD     | 434.462          | 0,18                         | CHARTER COMMUNICATIONS<br>OPERATING 5,75 % 01.04.48    | 675.000                  | USD     | 569.585   | 0,23                         |
|   |                          |         | <b>864.564</b>   | <b>0,35</b>                  | CHARTER COMMUNICATIONS OPE-<br>RATING 6,484 % 23.10.45 | 290.000                  | USD     | 269.744   | 0,11                         |
| <b>SCHWEDEN</b>                                   |                          |         |                  |                              | CITIGROUP 3,878 % VRN<br>24.01.39                      | 1.280.000                | USD     | 1.092.667 | 0,44                         |
| SKANDINAVISKA ENSKILDA<br>BANKEN 5,125 % 05.03.27 | 525.000                  | USD     | 526.293          | 0,21                         | CITIGROUP 4,7 % VRN PERP                               | 505.000                  | USD     | 494.520   | 0,20                         |
| SVENSKA HANDELSBANKEN<br>0,05 % 06.09.28          | 1.311.000                | EUR     | 1.236.513        | 0,50                         | CITIGROUP 5,827 % VRN<br>13.02.35                      | 770.000                  | USD     | 762.788   | 0,31                         |
| VATTENFALL 0,5 %<br>24.06.26                      | 1.000.000                | EUR     | 1.011.841        | 0,41                         | CONSTELLATION BRANDS<br>4,35 % 09.05.27                | 915.000                  | USD     | 897.471   | 0,36                         |
|   |                          |         | <b>2.774.647</b> | <b>1,12</b>                  | COREBRIDGE GLOBAL<br>FUNDING 5,9 % 19.09.28            | 2.000.000                | USD     | 2.054.488 | 0,83                         |
| <b>SCHWEIZ</b>                                    |                          |         |                  |                              | CROWN CASTLE INTERNATIONAL<br>4 % 15.11.49             | 1.000.000                | USD     | 779.176   | 0,31                         |
| CREDIT SUISSE LONDON<br>0,25 % 01.09.28           | 1.500.000                | EUR     | 1.412.363        | 0,57                         | DELL INTERNATIONAL 4,9 %<br>01/10/2026                 | 1.615.000                | USD     | 1.606.246 | 0,65                         |
|   |                          |         | <b>1.412.363</b> | <b>0,57</b>                  | DELL INTERNATIONAL<br>6,02 % 15.06.26                  | 82.000                   | USD     | 83.129    | 0,03                         |
| <b>USA</b>  |                          |         |                  |                              | ENEL FINANCE AMERICA<br>2,875 % 12.07.41               | 1.275.000                | USD     | 870.249   | 0,35                         |
| ABBVIE 5,4 % 15.03.54                             | 465.000                  | USD     | 479.678          | 0,19                         | FISERV 5,35 % 15.03.31                                 | 305.000                  | USD     | 308.875   | 0,12                         |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE<br>EQUITIES 4 % 01.02.50   | 825.000                  | USD     | 637.190          | 0,26                         | FIVE CORNERS FUNDING<br>TRUST 5,997 % 15.02.53         | 570.000                  | USD     | 605.027   | 0,24                         |
| AMAZONCOM 3,95 %<br>13.04.52                      | 1.020.000                | USD     | 861.189          | 0,35                         | FORD MOTOR CREDIT 6,05 %<br>05/03/2031                 | 660.000                  | USD     | 666.100   | 0,27                         |
| AMGEN 4,05 % 18.08.29                             | 2.000.000                | USD     | 1.923.678        | 0,77                         | FORTUNE BRANDS HOME<br>SECURITY 4,5 % 25.03.2052       | 470.000                  | USD     | 387.966   | 0,16                         |
| AMGEN 4,875 % 01.03.53                            | 330.000                  | USD     | 301.402          | 0,12                         | GENERAL MOTORS<br>FINANCIAL 2,7 % 20.08.27             | 1.770.000                | USD     | 1.633.343 | 0,66                         |
| APPLE 3,95 % 08.08.52                             | 500.000                  | USD     | 422.341          | 0,17                         | JACKSON FINANCIAL<br>3,125 % 23.11.31                  | 310.000                  | USD     | 259.029   | 0,10                         |
| ASHTHEAD CAPITAL 5,8 %<br>15.04.34                | 2.820.000                | USD     | 2.828.443        | 1,14                         |  |                          |         |           |                              |
| ATT 3,8 % 01.12.57                                | 908.000                  | USD     | 659.675          | 0,27                         |  |                          |         |           |                              |
| BANK OF AMERICA 2,482 %<br>VRN 21.09.36           | 1.000.000                | USD     | 800.080          | 0,32                         |  |                          |         |           |                              |
| BANK OF AMERICA 3,559 %<br>VRN 23.04.27           | 155.000                  | USD     | 149.685          | 0,06                         |  |                          |         |           |                              |
| BANK OF AMERICA 4,183 %<br>25.11.27               | 250.000                  | USD     | 242.809          | 0,10                         |  |                          |         |           |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Lower Carbon Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung                                       | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung                                   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|--|--------------------------|---------|--------------------|------------------------------|
| JPMORGAN CHASE & CO                                |                          |         |                   |                              | <b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>       |                          |         |                    |                              |
| 4,005 % VRN 23.04.29                               | 50.000                   | USD     | 47.960            | 0,02                         | <b>GROSSBRITANNIEN</b>                         |                          |         |                    |                              |
| LOWES 4,25 % 01.04.52                              | 755.000                  | USD     | 620.659           | 0,25                         | HSBC CORPORATE BOND FUND INS-                  |                          |         |                    |                              |
| MERCEDESSENZ FINANCE NORTH                         |                          |         |                   |                              | TITUTIONAL ACCUMULATION                        | 5.131.175                | GBP     | 23.198.921         | 9,33                         |
| AMERICA 5 % 11.01.34                               | 510.000                  | USD     | 506.141           | 0,20                         |  |                          |         | <b>23.198.921</b>  | <b>9,33</b>                  |
| MERCEDESSENZ FINANCE NORTH                         |                          |         |                   |                              | <b>IRLAND</b>                                  |                          |         |                    |                              |
| AMERICA 5,1 % 03.08.28                             | 325.000                  | USD     | 326.760           | 0,13                         | HSBC GLOBAL LIQUIDITY                          |                          |         |                    |                              |
| METROPOLITAN LIFE GLOBAL                           |                          |         |                   |                              | FUND   | 375                      | USD     | 375                | 0,00                         |
| FUNDING 5,4 % 12.09.28                             | 1.000.000                | USD     | 1.015.441         | 0,41                         |  |                          |         | <b>375</b>         | <b>0,00</b>                  |
| MORGAN STANLEY 1,164 %                             |                          |         |                   |                              | <b>SUMME ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b> |                          |         | <b>23.199.296</b>  | <b>9,33</b>                  |
| VRN 21.10.25                                       | 950.000                  | USD     | 925.263           | 0,37                         | <b>SUMME WERTPAPIERANLAGEN</b>                 |                          |         | <b>242.527.741</b> | <b>97,49</b>                 |
| MORGAN STANLEY 2,484 %                             |                          |         |                   |                              | <b>SONSTIGES NETTOVERMÖGEN</b>                 |                          |         | <b>6.233.191</b>   | <b>2,51</b>                  |
| VRN 16.09.36                                       | 160.000                  | USD     | 126.632           | 0,05                         | <b>GESAMTNETTOVERMÖGEN</b>                     |                          |         | <b>248.760.932</b> | <b>100,00</b>                |
| NESTLE CAPITAL 5,1 %                               |                          |         |                   |                              |  |                          |         |                    |                              |
| 12/03/2054   | 1.500.000                | USD     | 1.495.167         | 0,60                         |  |                          |         |                    |                              |
| NEW YORK LIFE GLOBAL                               |                          |         |                   |                              |  |                          |         |                    |                              |
| FUNDING 4,7 % 29.01.29                             | 3.000.000                | USD     | 2.971.254         | 1,19                         |  |                          |         |                    |                              |
| NEWMONT CORP NEWCREST                              |                          |         |                   |                              |  |                          |         |                    |                              |
| FINANCE 5,35 % 15.03.34                            | 465.000                  | USD     | 468.239           | 0,19                         |  |                          |         |                    |                              |
| PACCAR FINANCIAL 4,6 %                             |                          |         |                   |                              |  |                          |         |                    |                              |
| 31.01.29   | 4.000.000                | USD     | 3.978.386         | 1,59                         |  |                          |         |                    |                              |
| PRINCIPAL LIFE GLOBAL                              |                          |         |                   |                              |  |                          |         |                    |                              |
| FUNDING 5,1 % 25.01.29                             | 1.000.000                | USD     | 999.441           | 0,40                         |  |                          |         |                    |                              |
| ROCHE HOLDINGS 5,218 %                             |                          |         |                   |                              |  |                          |         |                    |                              |
| 08/03/2054   | 1.500.000                | USD     | 1.524.516         | 0,61                         |  |                          |         |                    |                              |
| SANTANDER HOLDINGS 3,5 %                           |                          |         |                   |                              |  |                          |         |                    |                              |
| 07/06/2024   | 875.000                  | USD     | 871.012           | 0,35                         |  |                          |         |                    |                              |
| STATE STREET 3,031 % VRN                           |                          |         |                   |                              |  |                          |         |                    |                              |
| 01/11/2034   | 915.000                  | USD     | 814.404           | 0,33                         |  |                          |         |                    |                              |
| SYNCHRONY FINANCIAL                                |                          |         |                   |                              |  |                          |         |                    |                              |
| 2,875 % 28.10.31                                   | 1.145.000                | USD     | 917.069           | 0,37                         |  |                          |         |                    |                              |
| SYNCHRONY FINANCIAL                                |                          |         |                   |                              |  |                          |         |                    |                              |
| 4,875 % 13.06.25                                   | 615.000                  | USD     | 606.215           | 0,24                         |  |                          |         |                    |                              |
| TMOBILE USA 3,5 %                                  |                          |         |                   |                              |  |                          |         |                    |                              |
| 15.04.31   | 500.000                  | USD     | 451.814           | 0,18                         |  |                          |         |                    |                              |
| TRUIST FINANCIAL 5,711 %                           |                          |         |                   |                              |  |                          |         |                    |                              |
| VRN 24.01.35                                       | 240.000                  | USD     | 241.580           | 0,10                         |  |                          |         |                    |                              |
| US (GOVT) 2,25 % 15.02.52                          | 75.000                   | USD     | 49.512            | 0,02                         |  |                          |         |                    |                              |
| US (GOVT) 4,25 % 28.02.29                          | 53.000                   | USD     | 53.122            | 0,02                         |  |                          |         |                    |                              |
| VERIZON COMMUNICATIONS                             |                          |         |                   |                              |  |                          |         |                    |                              |
| 2,85 % 03.09.41                                    | 500.000                  | USD     | 361.219           | 0,15                         |  |                          |         |                    |                              |
| WARNERMEDIA HOLDINGS                               |                          |         |                   |                              |  |                          |         |                    |                              |
| 5,05 % 15.03.42                                    | 375.000                  | USD     | 322.507           | 0,13                         |  |                          |         |                    |                              |
| WASTE MANAGEMENT 4,15 %                            |                          |         |                   |                              |  |                          |         |                    |                              |
| 15.04.32   | 685.000                  | USD     | 656.057           | 0,26                         |  |                          |         |                    |                              |
|  |                          |         | <b>47.667.787</b> | <b>19,16</b>                 |  |                          |         |                    |                              |
| <b>SUMME ANLEIHEN</b>                              |                          |         | <b>71.985.629</b> | <b>28,94</b>                 |  |                          |         |                    |                              |
| <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN</b>                |                          |         | <b>71.985.629</b> | <b>28,94</b>                 |  |                          |         |                    |                              |
| <b>MARKT GEHANDELTEN ÜBERTRAGBAREN WERTPAPIERE</b> |                          |         |                   |                              |  |                          |         |                    |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Securitised Credit Bond

Aufstellung der Wertpapiieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|--|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|
| <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>  |                          |         |                   |                              | <b>AN EINEM ANDEREM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE, ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |                          |         |                   |                              |
| <b>AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |                          |         |                   |                              | <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>                                      |                          |         |                   |                              |
| <b>ANLEIHEN</b>   |                          |         |                   |                              | <b>CHINA</b>   |                          |         |                   |                              |
| <b>GROSSBRITANNIEN</b>  |                          |         |                   |                              | ATRIUM XV FRN 23.01.2031   |                          |         |                   |                              |
| TRAFFORD CENTRE FINANCE   |                          |         |                   |                              | ATRIUM XV FRN  |                          |         |                   |                              |
| FRN 28.04.35  |                          |         |                   |                              | 23.01.2031 (US04965FAL58)  |                          |         |                   |                              |
|   | 2.150.000                | GBP     | 857.161           | 0,96                         |  | 1.250.000                | USD     | 1.241.703         | 1,38                         |
|   |                          |         | <b>857.161</b>    | <b>0,96</b>                  |  |                          |         | 1.250.435         | 1,40                         |
|   |                          |         |                   |                              |  |                          |         | <b>2.492.138</b>  | <b>2,78</b>                  |
| <b>SUMME ANLEIHEN</b>   |                          |         |                   |                              | <b>GROSSBRITANNIEN</b>   |                          |         |                   |                              |
|   |                          |         | <b>857.161</b>    | <b>0,96</b>                  | POLARIS FRN 23.12.2058   |                          |         |                   |                              |
|   |                          |         |                   |                              |  | 1.800.000                | GBP     | 2.269.497         | 2,53                         |
|   |                          |         |                   |                              |  |                          |         | <b>2.269.497</b>  | <b>2,53</b>                  |
| <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>                           |                          |         |                   |                              | <b>IRLAND</b>  |                          |         |                   |                              |
| <b>AUSTRALIEN</b>   |                          |         |                   |                              | BERG FINANCE FRN   |                          |         |                   |                              |
| LA TROBE FINANCIAL CAPITAL  |                          |         |                   |                              | 22.07.33   |                          |         |                   |                              |
| MARKET FRN 14.11.2053   |                          |         |                   |                              | CABINTEELY PARK CLO DAC  |                          |         |                   |                              |
| PEPPER RESIDENTIAL SECURITIES                                     |                          |         |                   |                              | FRN 15.08.34   |                          |         |                   |                              |
| TRUST FRN 12.03.61  |                          |         |                   |                              | CABINTEELY PARK CLO DAC FRN  |                          |         |                   |                              |
| PEPPER RESIDENTIAL  |                          |         |                   |                              | 15.08.2034 (XS2417672990)  |                          |         |                   |                              |
| TRUST FRN 18.11.60  |                          |         |                   |                              | DILOSK RMBS FRN  |                          |         |                   |                              |
|   | 1.810.000                | AUD     | 529.932           | 0,59                         |  | 2.000.000                | EUR     | 357.573           | 0,40                         |
|   | 600.000                  | AUD     | 103.044           | 0,11                         |  | 1.000.000                | EUR     | 1.063.083         | 1,19                         |
|   | 1.000.000                | AUD     | 86.321            | 0,10                         |  | 500.000                  | EUR     | 528.523           | 0,59                         |
|   |                          |         | <b>719.297</b>    | <b>0,80</b>                  |  | 900.000                  | EUR     | 977.687           | 1,09                         |
| <b>GROSSBRITANNIEN</b>  |                          |         |                   |                              | HAUS EUROPEAN LOAN   |                          |         |                   |                              |
| CANARY WHARF FRN  |                          |         |                   |                              | CONDUIT FRN 30.07.2051   |                          |         |                   |                              |
| 22.10.37  |                          |         |                   |                              | INVESCO CLO FRN 15.07.2034   |                          |         |                   |                              |
| POLARIS FRN 26.02.61  |                          |         |                   |                              | 15.04.33   |                          |         |                   |                              |
| PRECISE MORTGAGE FUNDING  |                          |         |                   |                              | JUBILEE CLO FRN  |                          |         |                   |                              |
| FRN 16.10.56  |                          |         |                   |                              | 20.11.31   |                          |         |                   |                              |
| RMAC SECURITIES FRN   |                          |         |                   |                              | LAST MILE LOGISTICS FRN  |                          |         |                   |                              |
| 12/06/2044  |                          |         |                   |                              | 17.08.26   |                          |         |                   |                              |
| STRATTON MORTGAGE   |                          |         |                   |                              | LAST MILE LOGISTICS FRN  |                          |         |                   |                              |
| FUNDING FRN 12.12.43  |                          |         |                   |                              | 17.08.2026 (XS2356454913)  |                          |         |                   |                              |
|   | 526.000                  | GBP     | 509.783           | 0,57                         |  | 1.000.000                | EUR     | 920.921           | 1,03                         |
|   | 900.000                  | GBP     | 1.139.797         | 1,27                         |  | 500.000                  | USD     | 488.938           | 0,55                         |
|   | 500.000                  | GBP     | 633.005           | 0,71                         |  | 1.000.000                | EUR     | 1.066.619         | 1,19                         |
|   | 1.800.000                | GBP     | 744.115           | 0,83                         |  | 1.000.000                | EUR     | 1.070.717         | 1,19                         |
|   | 1.550.000                | GBP     | 1.959.252         | 2,18                         |  | 1.000.000                | EUR     | 1.009.712         | 1,13                         |
|   |                          |         | <b>4.985.952</b>  | <b>5,56</b>                  |  | 1.640.000                | EUR     | 1.683.413         | 1,87                         |
| <b>IRLAND</b>   |                          |         |                   |                              | ST PAULS CLO XII   |                          |         |                   |                              |
| OTRANTO PARK CLO FRN  |                          |         |                   |                              | DAC FRN 15.04.33   |                          |         |                   |                              |
| 15.05.35  |                          |         |                   |                              | TAURUS FRN 17.05.2031  |                          |         |                   |                              |
| RIVER GREEN FINANCE FRN   |                          |         |                   |                              | (XS2303819929)   |                          |         |                   |                              |
| 22.01.32  |                          |         |                   |                              | TAURUS FRN 17.05.2031  |                          |         |                   |                              |
|   | 511.000                  | EUR     | 557.209           | 0,62                         |  | 500.000                  | GBP     | 603.452           | 0,67                         |
|   | 1.000.000                | EUR     | 717.651           | 0,80                         |  |                          |         | <b>12.988.538</b> | <b>14,48</b>                 |
|   |                          |         | <b>1.274.860</b>  | <b>1,42</b>                  | <b>USA</b>   |                          |         |                   |                              |
| <b>USA</b>  |                          |         |                   |                              | 225 LIBERTY STREET TRUST   |                          |         |                   |                              |
| CONNECTICUT AVENUE  |                          |         |                   |                              | 4,8035 % VRN 10.02.36  |                          |         |                   |                              |
| SECURITIES FRN 25.12.2041   |                          |         |                   |                              | 280 PARK AVENUE MORTGAGE FRN   |                          |         |                   |                              |
| SARANAC CLO FRN   |                          |         |                   |                              | 15.09.2034 (US90205FAL40)  |                          |         |                   |                              |
| 20.02.2033 (US80316TAG22)   |                          |         |                   |                              | ALLEGANY PARK CLO FRN  |                          |         |                   |                              |
|   | 1.225.000                | USD     | 1.235.735         | 1,38                         |  | 1.000.000                | USD     | 961.690           | 1,07                         |
|   | 1.250.000                | USD     | 1.250.543         | 1,39                         |  | 1.000.000                | USD     | 994.129           | 1,11                         |
|   |                          |         | <b>2.486.278</b>  | <b>2,77</b>                  |  | 1.000.000                | USD     | 999.962           | 1,12                         |
|   |                          |         | <b>2.486.278</b>  | <b>2,77</b>                  |  |                          |         |                   |                              |
| <b>SUMME FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>                     |                          |         |                   |                              | <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTEN WERTPAPIERE</b>              |                          |         |                   |                              |
|   |                          |         | <b>9.466.387</b>  | <b>10,55</b>                 |  |                          |         | <b>10.323.548</b> | <b>11,51</b>                 |
| <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTEN WERTPAPIERE</b>   |                          |         |                   |                              | <b>WERTPAPIERE</b>   |                          |         |                   |                              |
|   |                          |         | <b>10.323.548</b> | <b>11,51</b>                 |  |                          |         |                   |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Securitised Credit Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert  | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|-----------|------------------------------|---|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|
| APIDOS CLO XXXI FRN<br>15.04.31                       | 1.500.000                | USD     | 1.490.910 | 1,66                         | HUDSON YARDS MORTGAGE<br>3,557 % VRN 10.07.39                                       | 2.043.000                | USD     | 1.646.427         | 1,84                         |
| APIDOS CLO XXXIX<br>FRN 21.04.35                      | 750.000                  | USD     | 735.313   | 0,82                         | INVESCO CLO FRN<br>22.04.37   | 1.500.000                | USD     | 1.506.845         | 1,68                         |
| BAMLL COMMERCIAL MORTGAGE<br>3,7157 % VRN 14.04.33    | 1.000.000                | USD     | 955.460   | 1,07                         | JP MORGAN CHASE COMMITMENTS<br>3,44957 % VRN 05.01.39                               | 1.500.000                | USD     | 1.052.504         | 1,17                         |
| BBCMS MORTGAGE TRUST FRN<br>15.03.2037 (US05548WAG24) | 2.000.000                | USD     | 1.775.699 | 1,97                         | KNDL MORTGAGE TRUST FRN<br>15.05.2036 (US482598AQ24)                                | 1.000.000                | USD     | -                 | 0,00                         |
| BF NYT MORTGAGE TRUST<br>FRN 15.11.35                 | 518.500                  | USD     | 354.965   | 0,40                         | MADISON PARK FUNDING FRN<br>18.10.2030 (US55820CAL90)                               | 680.000                  | USD     | 678.953           | 0,76                         |
| BF MORTGAGE TRUST FRN<br>15.12.35                     | 1.150.000                | USD     | 966.325   | 1,08                         | NEUBERGER BERMAN CLO FRN<br>15.01.2030 (US64131WAJ62)                               | 1.000.000                | USD     | 993.594           | 1,11                         |
| BOYCE PARK CLO FRN<br>21.04.35                        | 1.000.000                | USD     | 988.645   | 1,10                         | NEUBERGER BERMAN CLO<br>FRN 18.10.30  | 1.500.000                | USD     | 1.490.423         | 1,66                         |
| BWAY MORTGAGE TRUST<br>3,7172 % 10.03.33              | 320.000                  | USD     | 275.476   | 0,31                         | NEUBERGER BERMAN LOAN<br>ADVISERS FRN 23.04.2038                                    | 1.000.000                | USD     | 1.000.000         | 1,12                         |
| BX TRUST FRN 25.11.2028                               | 1.000.000                | USD     | 695.984   | 0,78                         | PEEBLES CLO PARK FRN<br>21.04.37  | 1.500.000                | USD     | 1.500.000         | 1,67                         |
| CAMB COMMERCIAL MORTGAGE<br>TRUST FRN 15.12.37        | 2.250.000                | USD     | 2.246.346 | 2,50                         | PIKES PEAK CLO FRN<br>25.10.34  | 500.000                  | USD     | 478.295           | 0,53                         |
| CIFC FUNDING FRN<br>18.07.2031 (US12551YAE32)         | 1.200.000                | USD     | 1.199.988 | 1,34                         | PIKES PEAK CLO FRN<br>25.10.2034 (US72132UBG76)                                     | 1.000.000                | USD     | 989.418           | 1,10                         |
| CIFC FUNDING FRN<br>17.10.31                          | 1.000.000                | USD     | 999.959   | 1,12                         | PROGRESS RESIDENTIAL<br>2,409 % 17.05.38  | 1.000.000                | USD     | 913.212           | 1,02                         |
| CONNECTICUT AVENUE SECURITIES<br>TRUST FRN 25.02.44   | 1.000.000                | USD     | 1.005.645 | 1,12                         | PROGRESS RESIDENTIAL<br>5,2 % 17.04.39  | 1.660.000                | USD     | 1.591.226         | 1,77                         |
| CORE MORTGAGE TRUST FRN<br>15.12.31                   | 1.291.000                | USD     | 957.316   | 1,07                         | PROGRESS RESIDENTIAL<br>TRUST 2,082 % 17.09.38                                      | 1.935.000                | USD     | 1.746.791         | 1,95                         |
| DBGS MORTGAGE TRUST FRN<br>15.05.35                   | 1.000.000                | USD     | 904.480   | 1,01                         | PROGRESS RESIDENTIAL<br>TRUST 2,109 % 16.07.26                                      | 1.024.500                | USD     | 933.174           | 1,04                         |
| DBGS MORTGAGE TRUST FRN<br>15.05.2035 (US23306GAG29)  | 1.160.000                | USD     | 1.050.713 | 1,17                         | VANTAGE DATA CENTERS<br>1,992 % 15.09.45  | 1.400.000                | USD     | 1.235.576         | 1,38                         |
| FLEXENTIAL ISSUER 3,25 %<br>27.11.51                  | 1.000.000                | USD     | 908.224   | 1,01                         | VENTURE 28A CLO FRN<br>20.10.2034 (US92331CAE03)                                    | 1.500.000                | USD     | 1.259.778         | 1,40                         |
| FREDDIE MAC FRN<br>25.08.33                           | 1.000.000                | USD     | 876.322   | 0,98                         | WHETSTONE PARK CLO FRN<br>20.01.35  | 1.500.000                | USD     | 1.484.313         | 1,66                         |
| FREDDIE MAC STACR REMIC<br>TRUST FRN 25.10.33         | 1.500.000                | USD     | 1.527.179 | 1,70                         |   |                          |         | <b>52.925.537</b> | <b>59,02</b>                 |
| FREDDIE MAC STACR REMIC<br>TRUST FRN 25.01.51         | 1.250.000                | USD     | 813.011   | 0,91                         | <b>SUMME FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>                                       |                          |         | <b>70.675.710</b> | <b>78,81</b>                 |
| GALAXY XX CLO FRN<br>20.04.31                         | 500.000                  | USD     | 499.327   | 0,56                         | <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN<br/>MARKT GEHANDELTEN ÜBERTRAGBAREN WERTPAPIERE</b> |                          |         | <b>70.675.710</b> | <b>78,81</b>                 |
| GILBERT PARK FRN<br>15.10.30                          | 1.000.000                | USD     | 998.470   | 1,11                         | <b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>  |                          |         |                   |                              |
| HIGHBRIDGE LOAN MANAGEMENT<br>FRN 23.04.36            | 1.000.000                | USD     | 1.013.745 | 1,13                         | <b>IRLAND</b>   |                          |         |                   |                              |
| HOME PARTNERS OF<br>AMERICA 2,852 % 17.12.26          | 2.500.000                | USD     | 2.160.860 | 2,40                         | HSBC US DOLLAR ESG<br>LIQUIDITY FUND Y INC  | 5.297.850                | USD     | 5.297.850         | 5,91                         |
| HPS LOAN MANAGEMENT FRN<br>25.01.34                   | 1.000.000                | USD     | 967.903   | 1,08                         |   |                          |         | <b>5.297.850</b>  | <b>5,91</b>                  |
| HPS LOAN MANAGEMENT<br>15-2019 FRN 22.01.2035         | 1.000.000                | USD     | 964.642   | 1,08                         | <b>SUMME ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>                                      |                          |         | <b>5.297.850</b>  | <b>5,91</b>                  |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Securitised Credit Bond (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|
| <b>SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>                       |                          |         |                   |                              |
| <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>                        |                          |         |                   |                              |
| <b>AUSTRALIEN</b>  |                          |         |                   |                              |
| LA TROBE FINANCIAL CAPITAL<br>MARKET FRN 14.05.55              | 3.000.000                | AUD     | 1.972.358         | 2,20                         |
|  |                          |         | <b>1.972.358</b>  | <b>2,20</b>                  |
| <b>IRLAND</b>  |                          |         |                   |                              |
| ATOM MORTGAGE SECURITIES FRN<br>22.07.31                       | 1.500.000                | GBP     | 1.350.375         | 1,51                         |
|  |                          |         | <b>1.350.375</b>  | <b>1,51</b>                  |
| <b>SUMME FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>                  |                          |         | <b>3.322.733</b>  | <b>3,71</b>                  |
| <b>SUMME SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>                 |                          |         | <b>3.322.733</b>  | <b>3,71</b>                  |
| <b>SUMME WERTPAPIERANLAGEN</b>                                 |                          |         | <b>89.619.841</b> | <b>99,94</b>                 |
| <b>SONSTIGES NETTOVERMÖGEN ABZÜGLICH<br/>VERBINDLICHKEITEN</b> |                          |         | <b>52.680</b>     | <b>0,06</b>                  |
| <b>GESAMTNETTOVERMÖGEN</b>                                     |                          |         | <b>89.672.521</b> | <b>100,00</b>                |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Short Duration Bond

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|--|--------------------------|---------|----------|------------------------------|
| <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>  |                          |         |                   |                              | RCI BANQUE 3,75 %<br>04/10/2027                        |                          |         |          |                              |
| <b>AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |                          |         |                   |                              | 8.000.000 EUR 8.647.535 0,38                           |                          |         |          |                              |
| <b>ANLEIHEN</b>   |                          |         |                   |                              | SOCIETE GENERALE 0,594 %<br>25.02.26                   |                          |         |          |                              |
| <b>AUSTRALIEN</b>   |                          |         |                   |                              | 500.000.000 JPY 3.253.448 0,14                         |                          |         |          |                              |
| AUSNET SERVICES HOLDINGS<br>1,625 % VRN 11.03.81                  | 4.725.000                | EUR     | 4.711.717         | 0,21                         | SOCIETE GENERALE 5 %<br>19.05.27                       |                          |         |          |                              |
| WESTFIELD AMERICA MAN-<br>AGEMENT 2,125 % 30.03.2025              | 3.000.000                | GBP     | 3.657.702         | 0,16                         | SOCIETE GENERALE 8 % VRN<br>PERP                       |                          |         |          |                              |
|   |                          |         | <b>8.369.419</b>  | <b>0,37</b>                  | 7.500.000 USD 7.545.003 0,34                           |                          |         |          |                              |
| <b>BELGIEN</b>  |                          |         |                   |                              | TELEPERFORMANCE 5,25 %<br>22.11.28                     |                          |         |          |                              |
| KBC GROUP 6,151 % VRN<br>19.03.34                                 | 6.800.000                | GBP     | 8.658.438         | 0,39                         | 4.400.000 EUR 4.889.991 0,22                           |                          |         |          |                              |
|   |                          |         | <b>8.658.438</b>  | <b>0,39</b>                  | 3.125.000 EUR 3.375.000 0,15                           |                          |         |          |                              |
| <b>KANADA</b>   |                          |         |                   |                              | TOTAL 1,75 % VRN PERP<br>TOTALENERGIES 2 % VRN<br>PERP |                          |         |          |                              |
| ROYAL BANK OF CANADA<br>4,875 % 19.01.27                          | 5.950.000                | USD     | 5.941.425         | 0,26                         | 2.000.000 EUR 2.018.087 0,09                           |                          |         |          |                              |
|   |                          |         | <b>5.941.425</b>  | <b>0,26</b>                  | 5.300.000 EUR 5.180.122 0,23                           |                          |         |          |                              |
| <b>CHINA</b>  |                          |         |                   |                              | <b>146.744.999 6,53</b>                                |                          |         |          |                              |
| CHINA(GOVT) 3,01 %<br>13.05.28                                    | 215.000.000              | CNY     | 30.553.934        | 1,36                         | <b>DEUTSCHLAND</b>                                     |                          |         |          |                              |
|   |                          |         | <b>30.553.934</b> | <b>1,36</b>                  | CONTINENTAL AG 4 %<br>01/03/2027                       |                          |         |          |                              |
| <b>TSCHECHISCHE REPUBLIK</b>                                      |                          |         |                   |                              | 10.461.000 EUR 11.499.203 0,51                         |                          |         |          |                              |
| CZECH (GOVT) 2,5 %<br>25.08.28                                    | 70.000.000               | CZK     | 2.847.733         | 0,13                         | DEUTSCHE BANK 4 % VRN<br>24.06.26                      |                          |         |          |                              |
| CZECH (GOVT) 5,5 %<br>12/12/2028                                  | 76.000.000               | CZK     | 3.493.925         | 0,15                         | 10.500.000 GBP 12.968.678 0,58                         |                          |         |          |                              |
|   |                          |         | <b>6.341.658</b>  | <b>0,28</b>                  | DEUTSCHE BANK 10 % VRN<br>PERP                         |                          |         |          |                              |
| <b>FRANKREICH</b>   |                          |         |                   |                              | 4.000.000 EUR 4.695.971 0,21                           |                          |         |          |                              |
| ALD 3,875 % 24.01.28  | 13.000.000               | EUR     | 14.124.116        | 0,63                         | EUROGRID GMBH 3,598 %<br>01/02/2029                    |                          |         |          |                              |
| ALD 4,875 % 06.10.28  | 8.600.000                | EUR     | 9.731.740         | 0,43                         | 7.500.000 EUR 8.165.065 0,36                           |                          |         |          |                              |
| BANQUE STELLANTIS<br>FRANCE 4 % 21.01.27                          | 5.200.000                | EUR     | 5.680.232         | 0,25                         | GERMANY (GOVT) 0 %<br>09/10/2026                       |                          |         |          |                              |
| BNP PARIBAS 2 % VRN<br>24.05.31                                   | 5.000.000                | GBP     | 5.811.357         | 0,26                         | 78.270.000 EUR 79.227.514 3,52                         |                          |         |          |                              |
| BNP PARIBAS 3,695 % VRN<br>24.02.28                               | 3.000.000                | AUD     | 1.853.260         | 0,08                         | <b>116.556.431 5,18</b>                                |                          |         |          |                              |
| BPCE 2,5 % VRN 30.11.32   | 3.000.000                | GBP     | 3.361.805         | 0,15                         | <b>GROSSBRITANNIEN</b>                                 |                          |         |          |                              |
| CREDIT AGRICOLE 5,375 %<br>VRN 15.01.29                           | 10.100.000               | GBP     | 12.873.270        | 0,57                         | BARCLAYS 0,654 % VRN<br>09/06/2027                     |                          |         |          |                              |
| CREDIT AGRICOLE 6,875 %<br>VRN PERP                               | 9.500.000                | USD     | 9.501.155         | 0,42                         | 1.500.000.000 JPY 9.667.016 0,43                       |                          |         |          |                              |
| ELECTRICITE DE FRANCE<br>2,875 % VRN PERP                         | 6.600.000                | EUR     | 6.644.331         | 0,30                         | BARCLAYS 2,166 % VRN<br>23.06.27                       |                          |         |          |                              |
| ELECTRICITE DE FRANCE<br>5 % VRN PERP                             | 1.100.000                | EUR     | 1.179.744         | 0,05                         | 3.000.000 CAD 2.071.595 0,09                           |                          |         |          |                              |
| ELECTRICITE DE FRANCE<br>6 % VRN PERP                             | 7.200.000                | GBP     | 8.888.658         | 0,40                         | 500.000 GBP 623.579 0,03                               |                          |         |          |                              |
| ELIS 3,75 % 21.03.30  | 4.500.000                | EUR     | 4.847.611         | 0,22                         | BP CAPITAL MARKETS<br>3,25 % VRN PERP                  |                          |         |          |                              |
| KERING 5,125 % 23.11.26   | 10.800.000               | GBP     | 13.721.191        | 0,61                         | BP CAPITAL MARKETS<br>4,375 % VRN PERP                 |                          |         |          |                              |
| ORANGE 1,75 % VRN PERP  | 8.500.000                | EUR     | 8.545.339         | 0,38                         | 1.341.000 USD 1.317.942 0,06                           |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                   |                              | 1.000.000 GBP 1.234.457 0,05                           |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                   |                              | CYBG 4 % VRN 25.09.2026                                |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                   |                              | HEATHROW FINANCE 5,75 %<br>03/03/2025                  |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                   |                              | 4.364.000 GBP 5.500.428 0,24                           |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                   |                              | HSBC HOLDINGS 0,797 %<br>VRN 14.09.26                  |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                   |                              | 400.000.000 JPY 2.625.259 0,12                         |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                   |                              | HSBC HOLDINGS 6,364 %<br>VRN 16.11.32                  |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                   |                              | 6.125.000 EUR 7.076.049 0,31                           |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                   |                              | LLOYDS BANKING 5,125 %<br>VRN PERP                     |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                   |                              | 9.150.000 GBP 11.364.285 0,51                          |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                   |                              | LLOYDS BANKING GROUP<br>5,462 % 05.01.28               |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                   |                              | 14.584.000 USD 14.601.467 0,65                         |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                   |                              | NATIONWIDE BUILDING<br>SOCIETY 2 % VRN 25.07.29        |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                   |                              | 7.000.000 EUR 7.496.893 0,33                           |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                   |                              | NATIONWIDE BUILDING SOCIETY<br>6,557 % VRN 18.10.27    |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                   |                              | 10.321.000 USD 10.596.516 0,47                         |                          |         |          |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Short Duration Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|--------------------|------------------------------|---|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|
| NGG FINANCE 5,625 % VRN<br>18.06.73   | 11.200.000               | GBP     | 14.022.784         | 0,62                         | <b>JERSEY</b><br>HEATHROW FUNDING 6,75 %<br>03/12/2028              | 2.000.000                | GBP     | 2.626.064         | 0,12                         |
| PENSION INSURANCE 8 %<br>23.11.26   | 1.500.000                | GBP     | 1.975.802          | 0,09                         |   |                          |         | <b>2.626.064</b>  | <b>0,12</b>                  |
| PGH CAPITAL 6,625 %<br>18.12.25   | 484.000                  | GBP     | 620.187            | 0,03                         | <b>LUXEMBURG</b><br>AROUNDTOWN 1,625 % VRN<br>PERP                  | 7.700.000                | EUR     | 4.043.443         | 0,18                         |
| ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP<br>3,622 % VRN 14.08.30                            | 17.000.000               | GBP     | 20.848.316         | 0,93                         | AROUNDTOWN 2,875 % VRN<br>PERP                                      | 3.400.000                | EUR     | 1.919.018         | 0,09                         |
| STANDARD CHARTERED 2,5 %<br>VRN 09.09.30  | 750.000                  | EUR     | 789.559            | 0,04                         | LOGICOR FINANCING<br>4,625 % 25.07.28                               | 6.653.000                | EUR     | 7.275.649         | 0,32                         |
| VIRGIN MONEY 4 % VRN<br>18.03.28  | 4.306.000                | EUR     | 4.669.478          | 0,21                         |   |                          |         | <b>13.238.110</b> | <b>0,59</b>                  |
| VIRGIN MONEY 5,125 % VRN<br>11/12/2030  | 648.000                  | GBP     | 805.499            | 0,04                         | <b>MACAU</b><br>SANDS CHINA 5,125 %<br>08/08/2025                   | 5.000.000                | USD     | 4.933.821         | 0,22                         |
| VIRGIN MONEY 8,25 % VRN<br>PERP   | 3.000.000                | GBP     | 3.817.422          | 0,17                         |   |                          |         | <b>4.933.821</b>  | <b>0,22</b>                  |
| VIRGIN MONEY UK 2,625 %<br>VRN 19.08.31   | 2.252.000                | GBP     | 2.637.992          | 0,12                         | <b>MEXIKO</b><br>MEXICO (GOVT) 7,5 %<br>03/06/2027                  | 3.850.000                | MXN     | 21.933.674        | 0,98                         |
| VODAFONE GROUP 2,625 %<br>VRN 27.08.80  | 3.550.000                | EUR     | 3.684.962          | 0,16                         | MEXICO (GOVT) 8,5 %<br>31.05.29                                     | 3.900.000                | MXN     | 22.748.983        | 1,01                         |
| VODAFONE GROUP 4,875 %<br>VRN 03.10.78  | 6.500.000                | GBP     | 8.082.699          | 0,36                         |   |                          |         | <b>44.682.657</b> | <b>1,99</b>                  |
| WPP FINANCE 3,625 %<br>12/09/2029   | 9.421.000                | EUR     | 10.182.676         | 0,45                         | <b>NIEDERLANDE</b><br>COOPERATIEVE RABOBANK<br>3,913 % 03.11.26     | 10.400.000               | EUR     | 11.408.688        | 0,51                         |
|   |                          |         | <b>149.684.057</b> | <b>6,66</b>                  | ENEL FINANCE 3,375 %<br>23.07.28                                    | 8.727.000                | EUR     | 9.453.102         | 0,42                         |
| <b>HONGKONG</b><br>STUDIO CITY FINANCE 5 %<br>15.01.29                          | 2.000.000                | USD     | 1.762.888          | 0,08                         | MERCEDESSENZ INTERNATIONAL<br>FINANCE 3 % 10.07.27                  | 7.500.000                | EUR     | 8.052.941         | 0,36                         |
| STUDIO CITY FINANCE<br>6,5 % 15.01.28   | 4.000.000                | USD     | 3.814.466          | 0,17                         | MERCEDESSENZ INTERNATIONAL<br>FINANCE 5,625 % 17.08.26              | 5.200.000                | GBP     | 6.685.489         | 0,30                         |
|   |                          |         | <b>5.577.354</b>   | <b>0,25</b>                  | PETROBRAS GLOBAL<br>FINANCE 5,093 % 15.01.30                        | 500                      | USD     | 477               | 0,00                         |
| <b>IRLAND</b><br>AVOLON HOLDINGS FUNDING<br>5,75 % 01.03.29                     | 9.560.000                | USD     | 9.536.170          | 0,42                         | SANDOZ FINANCE 3,97 %<br>17.04.27                                   | 14.000.000               | EUR     | 15.370.294        | 0,68                         |
| BANK OF IRELAND GROUP<br>1,875 % VRN 05.06.26                                   | 6.875.000                | EUR     | 7.253.950          | 0,32                         |   |                          |         | <b>50.970.991</b> | <b>2,27</b>                  |
| CA AUTO BANK<br>6 % 06.12.26  | 16.239.000               | GBP     | 20.832.095         | 0,93                         | <b>NEUSEELAND</b><br>NEW ZEALAND (GOVT)<br>0,25 % 15.05.28          | 50.500.000               | NZD     | 25.578.502        | 1,14                         |
| WILLOW 4,25 % VRN<br>01/10/2045   | 7.680.000                | USD     | 7.460.709          | 0,33                         | NEW ZEALAND (GOVT) 4,5 %<br>15.04.27                                | 33.900.000               | NZD     | 20.323.911        | 0,90                         |
|   |                          |         | <b>45.082.924</b>  | <b>2,00</b>                  |   |                          |         | <b>45.902.413</b> | <b>2,04</b>                  |
| <b>ITALIEN</b><br>ENEL 4,75 % VRN PERP<br>INTESA SANPAOLO 1,464 %<br>09/03/2026 | 14.268.000               | EUR     | 15.321.743         | 0,68                         | <b>POLEN</b><br>POLAND (GOVT) 2,75 %<br>25.04.28                    | 44.000.000               | PLN     | 10.068.127        | 0,45                         |
| 09/03/2026  | 200.000.000              | JPY     | 1.319.443          | 0,06                         | REPUBLIC OF POLAND GOVERN-<br>MENT I 4,625 % 18.03.2029             | 14.118.000               | USD     | 14.004.813        | 0,62                         |
| ITALGAS SPA 3,125 %<br>08/02/2029   | 7.753.000                | EUR     | 8.240.925          | 0,37                         |   |                          |         | <b>24.072.940</b> | <b>1,07</b>                  |
| LEASYS 4,625 % 16.02.27   | 9.344.000                | EUR     | 10.321.227         | 0,46                         | <b>PORTUGAL</b><br>EDP ENERGIAS DE PORTUGAL<br>1,875 % VRN 02.08.81 | 6.200.000                | EUR     | 6.297.107         | 0,28                         |
| TELECOM ITALIA 6,875 %<br>15.02.28  | 4.000.000                | EUR     | 4.579.991          | 0,20                         |   |                          |         | <b>6.297.107</b>  | <b>0,28</b>                  |
|   |                          |         | <b>39.783.329</b>  | <b>1,77</b>                  |   |                          |         |                   |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Short Duration Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung                 | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung                        | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------------------------|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|-------------------------------------|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|
| <b>RUMÄNIEN</b>              |                          |         |                   |                              | UBS GROUP 6,327 % VRN               |                          |         |                   |                              |
| ROMANIA (GOVT) 2,375 %       |                          |         |                   |                              | 22.12.27                            | 4.000.000                | USD     | 4.089.002         | 0,18                         |
| 19.04.27                     | 2.500.000                | EUR     | 2.572.819         | 0,11                         |                                     |                          |         | <b>44.963.375</b> | <b>2,00</b>                  |
| ROMANIA (GOVT) 5 %           |                          |         |                   |                              | <b>VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE</b> |                          |         |                   |                              |
| 27.09.26                     | 5.057.000                | EUR     | 5.607.712         | 0,25                         | FIRST ABU DHABI BANK                |                          |         |                   |                              |
|                              |                          |         | <b>8.180.531</b>  | <b>0,36</b>                  | 5 % 28.02.29                        | 14.146.000               | USD     | 14.086.122        | 0,63                         |
| <b>SERBIEN</b>               |                          |         |                   |                              |                                     |                          |         | <b>14.086.122</b> | <b>0,63</b>                  |
| SERBIA (GOVT) 6,25 %         |                          |         |                   |                              | <b>USA</b>                          |                          |         |                   |                              |
| 26.05.28                     | 3.030.000                | USD     | 3.096.453         | 0,14                         | AMERICAN EXPRESS 5,098 %            |                          |         |                   |                              |
|                              |                          |         | <b>3.096.453</b>  | <b>0,14</b>                  | VRN 16.02.28                        | 6.767.000                | USD     | 6.759.116         | 0,30                         |
| <b>SÜDKOREA</b>              |                          |         |                   |                              | AMERICAN EXPRESS 5,282 %            | 6.205.000                | USD     | 6.248.540         | 0,28                         |
| KOREA (GOVT) 2,375 %         |                          |         |                   |                              | VRN 27.07.29                        |                          |         |                   |                              |
| 10/12/2027                   | 15.000.010.000           | KRW     | 10.772.023        | 0,48                         | AMERICAN TOWER 4,125 %              |                          |         |                   |                              |
| KOREA (GOVT) 2,375 %         |                          |         |                   |                              | 16.05.27                            | 13.261.000               | EUR     | 14.514.754        | 0,64                         |
| 10/12/2028                   | 6.000.000.000            | KRW     | 4.265.675         | 0,19                         | BANK OF AMERICA 1,734 %             |                          |         |                   |                              |
|                              |                          |         | <b>15.037.698</b> | <b>0,67</b>                  | VRN 22.07.27                        | 4.000.000                | USD     | 3.691.193         | 0,16                         |
| <b>SPANIEN</b>               |                          |         |                   |                              | BANK OF AMERICA 5,526 %             |                          |         |                   |                              |
| BANCO SANTANDER 5,538 %      |                          |         |                   |                              | 18.08.26                            | 13.550.000               | USD     | 13.699.149        | 0,61                         |
| VRN 14.03.30                 | 13.800.000               | USD     | 13.806.438        | 0,61                         | BAXTER INTERNATIONAL                |                          |         |                   |                              |
| BANCO SANTANDER 6,527 %      |                          |         |                   |                              | 2,6 % 15.08.26                      | 5.000.000                | USD     | 4.709.079         | 0,21                         |
| VRN 07.11.27                 | 18.000.000               | USD     | 18.478.338        | 0,82                         | CARRIER GLOBAL 4,125 %              |                          |         |                   |                              |
| CAIXABANK 5,25 % VRN PERP    | 6.000.000                | EUR     | 6.211.140         | 0,28                         | 29.05.28                            | 3.706.000                | EUR     | 4.096.563         | 0,18                         |
| CAIXABANK 1,25 % VRN         |                          |         |                   |                              | CARRIER GLOBAL 4,375 %              |                          |         |                   |                              |
| 18.06.31                     | 2.000.000                | EUR     | 2.024.757         | 0,09                         | 29.05.25                            | 6.176.000                | EUR     | 6.697.893         | 0,30                         |
| CAIXABANK 1,625 % VRN        |                          |         |                   |                              | CNH INDUSTRIAL CAPITAL              |                          |         |                   |                              |
| 13.04.26                     | 1.500.000                | EUR     | 1.583.699         | 0,07                         | 5,1 % 20.04.29                      | 8.245.000                | USD     | 8.228.999         | 0,37                         |
| CELLNEX FINANCE 1 %          |                          |         |                   |                              | ENERGY TRANSFER 6,05 %              |                          |         |                   |                              |
| 15.09.27                     | 8.000.000                | EUR     | 7.921.646         | 0,35                         | 01/12/2026                          | 2.786.000                | USD     | 2.845.161         | 0,13                         |
| CELLNEX FINANCE 2,25 %       |                          |         |                   |                              | FISERV 5,375 % 21.08.28             | 5.654.000                | USD     | 5.717.596         | 0,25                         |
| 12/04/2026                   | 4.400.000                | EUR     | 4.619.349         | 0,21                         | FORD MOTOR CREDIT                   |                          |         |                   |                              |
|                              |                          |         | <b>54.645.367</b> | <b>2,43</b>                  | 2,748 % 14.06.24                    | 177.000                  | GBP     | 222.279           | 0,01                         |
| <b>SCHWEDEN</b>              |                          |         |                   |                              | FORD MOTOR CREDIT 4,95 %            |                          |         |                   |                              |
| AKELIUS RESIDENTIAL PROPERTY |                          |         |                   |                              | 28.05.27                            | 2.500.000                | USD     | 2.441.846         | 0,11                         |
| 2,249 % VRN 17.05.81         | 5.000.000                | EUR     | 4.955.635         | 0,22                         | FORD MOTOR CREDIT                   |                          |         |                   |                              |
| MOLNLYCKE HOLDING 4,25 %     |                          |         |                   |                              | 5,625 % 09.10.28                    | 4.923.000                | GBP     | 6.250.614         | 0,28                         |
| 08/09/2028                   | 8.002.000                | EUR     | 8.813.184         | 0,39                         | FORD MOTOR CREDIT                   |                          |         |                   |                              |
|                              |                          |         | <b>13.768.819</b> | <b>0,61</b>                  | 6,798 % 07.11.28                    | 3.831.000                | USD     | 4.000.729         | 0,18                         |
| <b>SCHWEIZ</b>               |                          |         |                   |                              | FORD MOTOR CREDIT 6,86 %            |                          |         |                   |                              |
| CREDIT SUISSE AGLONDON       |                          |         |                   |                              | 05/06/2026                          | 5.000.000                | GBP     | 6.498.465         | 0,29                         |
| 7,75 % 10.03.26              | 2.818.000                | GBP     | 3.730.131         | 0,17                         | GENERAL MOTORS                      |                          |         |                   |                              |
| CREDIT SUISSE GROUP          |                          |         |                   |                              | FINANCIAL 3,9 % 12.01.28            | 5.000.000                | EUR     | 5.453.325         | 0,24                         |
| 2,125 % VRN 12.09.25         | 2.410.000                | GBP     | 2.999.716         | 0,13                         | GENERAL MOTORS                      |                          |         |                   |                              |
| CREDIT SUISSE GROUP          |                          |         |                   |                              | FINANCIAL 5,15 % 15.08.26           | 4.867.000                | GBP     | 6.124.684         | 0,27                         |
| 2,125 % VRN 13.10.26         | 7.000.000                | EUR     | 7.364.774         | 0,33                         | GENERAL MOTORS                      |                          |         |                   |                              |
| CREDIT SUISSE GROUP          |                          |         |                   |                              | FINANCIAL 5,4 % 08.05.27            | 2.714.000                | USD     | 2.723.663         | 0,12                         |
| 6,373 % VRN 15.07.26         | 10.364.000               | USD     | 10.442.588        | 0,46                         | GENERAL MOTORS                      |                          |         |                   |                              |
| SWISS (GOVT) 3,25 %          |                          |         |                   |                              | FINANCIAL 5,8 % 07.01.29            | 8.324.000                | USD     | 8.481.781         | 0,38                         |
| 27.06.27                     | 5.000.000                | CHF     | 5.982.778         | 0,27                         | GLOBAL PAYMENTS 4,45 %              |                          |         |                   |                              |
| UBS GROUP 4,875 % VRN        |                          |         |                   |                              | 01/06/2028                          | 2.523.000                | USD     | 2.445.513         | 0,11                         |
| PERP                         | 4.000.000                | USD     | 3.682.574         | 0,16                         | JPMORGAN CHASE 4,6 % VRN            |                          |         |                   |                              |
| UBS GROUP 5,125 % VRN        |                          |         |                   |                              | PERP                                | 11.000.000               | USD     | 10.852.432        | 0,48                         |
| PERP                         | 7.000.000                | USD     | 6.671.812         | 0,30                         | JPMORGAN CHASE 5,04 %               |                          |         |                   |                              |
|                              |                          |         |                   |                              | VRN 23.01.28                        | 5.000.000                | USD     | 4.988.140         | 0,22                         |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Short Duration Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert             | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert             | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|----------------------|------------------------------|--|--------------------------|---------|----------------------|------------------------------|
| MASSMUTUAL GLOBAL<br>FUNDING 5 % 12.12.27           | 11.020.000               | GBP     | 14.117.310           | 0,63                         | HARVEST CLO FRN<br>20.10.32  | 1.500.000                | EUR     | 1.592.479            | 0,07                         |
| MCDONALDS 3,625 %<br>28.11.27                       | 8.500.000                | EUR     | 9.278.469            | 0,41                         | HARVEST CLO VIII FRN<br>15.01.31   | 2.500.000                | EUR     | 2.673.439            | 0,12                         |
| MORGAN STANLEY 5,449 %<br>VRN 20.07.29              | 1.567.000                | USD     | 1.582.526            | 0,07                         | INVESCO EURO FRN<br>15.07.31   | 8.000.000                | EUR     | 8.408.537            | 0,37                         |
| OCCIDENTAL PETROLEUM<br>5,55 % 15.03.26             | 7.500.000                | USD     | 7.532.752            | 0,34                         | INVESCO FRN 15.07.2031   | 2.963.000                | EUR     | 3.130.378            | 0,14                         |
| SOUTHERN 5,5 % 15.03.2029                           | 15.392.000               | USD     | 15.692.179           | 0,69                         | LAST MILE LOGISTICS PAN EURO<br>FINANCE FRN 17.08.2033                           | 3.000.000                | EUR     | 3.132.722            | 0,14                         |
| STRYKER 3,375 % 11.12.2028                          | 4.243.000                | EUR     | 4.620.710            | 0,21                         | PENTA CLO FRN 17.12.30   | 2.900.000                | EUR     | 3.122.089            | 0,14                         |
| SYNCHRONY BANK 5,4 %<br>22.08.25                    | 6.000.000                | USD     | 5.950.289            | 0,26                         | RIVER GREEN FINANCE FRN<br>22.01.32  | 900.000                  | EUR     | 659.714              | 0,03                         |
| SYNCHRONY BANK 5,625 %<br>23.08.27                  | 3.000.000                | USD     | 2.948.744            | 0,13                         | ST PAUL'S CLO FRN<br>15.04.33  | 2.000.000                | EUR     | 2.119.233            | 0,09                         |
| T MOBILE 4,75 % 01.02.2028                          | 10.000.000               | USD     | 9.877.096            | 0,44                         | ST PAUL'S CLO FRN<br>22.04.35  | 2.000.000                | EUR     | 2.146.568            | 0,10                         |
| TMOBILE 3,75 % 15.04.27                             | 2.000.000                | USD     | 1.927.904            | 0,09                         | STARK FINANCING FRN<br>17.08.33  | 2.500.000                | GBP     | 3.166.652            | 0,14                         |
| TOYOTA MOTOR CREDIT 5 %<br>14.08.26                 | 6.520.000                | USD     | 6.532.906            | 0,29                         | TAURUS CMBS FRN<br>20.02.30  | 1.000.000                | EUR     | 440.330              | 0,02                         |
| UNITED STATES TREASURY<br>NOTE BOND 2,5 % 31.03.27  | 7.230.000                | USD     | 6.851.555            | 0,30                         | TAURUS DAC FRN 17.08.2031  | 7.000.000                | GBP     | 5.583.573            | 0,25                         |
|   |                          |         | <b>224.603.954</b>   | <b>9,98</b>                  |  |                          |         | <b>49.573.429</b>    | <b>2,21</b>                  |
| <b>SUMME ANLEIHEN</b>                               |                          |         | <b>1.134.400.390</b> | <b>50,45</b>                 | <b>ITALIEN</b>   |                          |         |                      |                              |
| <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>             |                          |         |                      |                              | CASSIA FRN 22.05.2034  | 900.000                  | EUR     | 959.930              | 0,04                         |
| <b>AUSTRALIEN</b>                                   |                          |         |                      |                              |  |                          |         | <b>959.930</b>       | <b>0,04</b>                  |
| LA TROBE FINANCIAL CAPITAL<br>MARKET FRN 14.11.2053 | 1.810.000                | AUD     | 528.823              | 0,02                         | <b>NIEDERLANDE</b>   |                          |         |                      |                              |
| LION SERIES TRUST FRN<br>18.05.54                   | 2.950.000                | AUD     | 1.400.480            | 0,07                         | JUBILEE CLO FRN<br>15.06.32  | 2.300.000                | EUR     | 2.468.387            | 0,11                         |
|   |                          |         | <b>1.929.303</b>     | <b>0,09</b>                  |  |                          |         | <b>2.468.387</b>     | <b>0,11</b>                  |
| <b>GROSSBRITANNIEN</b>                              |                          |         |                      |                              | <b>USA</b>   |                          |         |                      |                              |
| GEMGARTO PLC FRN<br>16.12.67                        | 2.200.000                | GBP     | 2.778.872            | 0,12                         | AMERICAN HOMES 4,201 %<br>17.12.36   | 1.300.000                | USD     | 1.282.861            | 0,06                         |
| GREAT HALL MORTGAGES<br>FRN 18.06.39                | 2.500.000                | GBP     | 2.939.504            | 0,13                         | AMERICAN HOMES 5,639 %<br>17.04.52   | 2.800.000                | USD     | 2.781.867            | 0,12                         |
| LANEBROOK MTG TRANSACTION<br>FRN 20.07.58           | 1.684.000                | GBP     | 2.111.564            | 0,09                         |  |                          |         | <b>4.064.728</b>     | <b>0,18</b>                  |
| PIERPONT FRN 21.09.2054                             | 2.100.000                | GBP     | 2.458.770            | 0,11                         | <b>SUMME FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>                                    |                          |         | <b>82.327.334</b>    | <b>3,66</b>                  |
| PMF FRN 16.07.2060                                  | 6.800.000                | GBP     | 8.586.966            | 0,38                         | <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN<br/>BÖRSE NOTIERTEN WERTPAPIERE</b>              |                          |         | <b>1.216.727.724</b> | <b>54,11</b>                 |
| RESLOC FRN 15.12.2043                               | 2.000.000                | GBP     | 726.444              | 0,03                         | <b>WERTPAPIERE</b>   |                          |         |                      |                              |
| RMAC SECURITIES FRN<br>12/06/2044                   | 2.510.000                | EUR     | 881.688              | 0,04                         | <b>AN EINEM ANDEREM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE, ÜBERTRAGBARE<br/>WERTPAPIERE</b> |                          |         |                      |                              |
| TWIN BRIDGES FRN<br>14.06.55                        | 3.000.000                | GBP     | 2.847.749            | 0,13                         | <b>ANLEIHEN</b>  |                          |         |                      |                              |
|   |                          |         | <b>23.331.557</b>    | <b>1,03</b>                  | <b>AUSTRALIEN</b>  |                          |         |                      |                              |
| <b>IRLAND</b>                                       |                          |         |                      |                              | QBE INSURANCE GROUP<br>5,875 % VRN PERP  | 500.000                  | USD     | 495.029              | 0,02                         |
| CVC CORDATUS LOAN FUND<br>FRN 17.06.32              | 8.000.000                | EUR     | 8.599.401            | 0,38                         |  |                          |         | <b>495.029</b>       | <b>0,02</b>                  |
| CVC CORDATUS LOAN FUND<br>FRN 17.06.32              | 3.425.000                | EUR     | 3.730.589            | 0,17                         | <b>BELGIEN</b>   |                          |         |                      |                              |
| DRYDEN CLO FRN 15.04.2035                           | 1.000.000                | EUR     | 1.067.725            | 0,05                         | SOLVAY 3,875 % 03.04.28  | 6.600.000                | EUR     | 7.161.786            | 0,32                         |
|   |                          |         |                      |                              |  |                          |         | <b>7.161.786</b>     | <b>0,32</b>                  |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Short Duration Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung               | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung               | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|----------------------------|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|----------------------------|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|
| <b>KANADA</b>              |                          |         |                   |                              | ROTHESAY LIFE 5,5 % VRN    |                          |         |                   |                              |
| CANADIAN IMPERIAL BANK     |                          |         |                   |                              | 17.09.29                   | 2.700.000                | GBP     | 3.395.287         | 0,15                         |
| 2,95 % VRN 19.06.29        | 1.500.000                | CAD     | 1.102.586         | 0,05                         | YORKSHIRE BUILDING         |                          |         |                   |                              |
|                            |                          |         | <b>1.102.586</b>  | <b>0,05</b>                  | SOCIETY 7,375 % VRN        |                          |         |                   |                              |
| <b>CHILE</b>               |                          |         |                   |                              | 12/09/2027                 | 6.050.000                | GBP     | 7.936.773         | 0,35                         |
| CODELCO 3,625 % 01.08.2027 | 5.000.000                | USD     | 4.726.393         | 0,21                         |                            |                          |         | <b>53.138.794</b> | <b>2,36</b>                  |
|                            |                          |         | <b>4.726.393</b>  | <b>0,21</b>                  | <b>INDIEN</b>              |                          |         |                   |                              |
| <b>CHINA</b>               |                          |         |                   |                              | HDFC BANK 5,196 %          |                          |         |                   |                              |
| CHINA(GOVT) 2,4 %          |                          |         |                   |                              | 15.02.27                   | 13.807.000               | USD     | 13.721.872        | 0,61                         |
| 15.07.28                   | 200.000.000              | CNY     | 27.747.497        | 1,24                         |                            |                          |         | <b>13.721.872</b> | <b>0,61</b>                  |
| CHINA(GOVT) 2,55 %         |                          |         |                   |                              | <b>IRLAND</b>              |                          |         |                   |                              |
| 15.10.28                   | 94.000.000               | CNY     | 13.138.983        | 0,58                         | AVOLON HOLDINGS FUNDING    |                          |         |                   |                              |
| EXPORT IMPORT BANK OF      |                          |         |                   |                              | 4,25 % 15.04.26            | 3.181.000                | USD     | 3.074.474         | 0,14                         |
| CHINA 2,87 % 06.02.28      | 96.000.000               | CNY     | 13.496.871        | 0,60                         | SMURFIT KAPPA TREASURY     |                          |         |                   |                              |
| EXPORT IMPORT BANK OF      |                          |         |                   |                              | 5,2 % 15.01.30             | 3.628.000                | USD     | 3.625.407         | 0,16                         |
| CHINA 4,89 % 26.03.28      | 65.000.000               | CNY     | 9.831.744         | 0,44                         |                            |                          |         | <b>6.699.881</b>  | <b>0,30</b>                  |
| SANDS CHINA 3,8 %          |                          |         |                   |                              | <b>ISRAEL</b>              |                          |         |                   |                              |
| 08/01/2026                 | 4.000.000                | USD     | 3.848.361         | 0,17                         | ENERGEAN ISRAEL FINANCE    |                          |         |                   |                              |
|                            |                          |         | <b>68.063.456</b> | <b>3,03</b>                  | 4,875 % 30.03.26           | 12.500.000               | USD     | 11.888.696        | 0,53                         |
| <b>KOLUMBIEN</b>           |                          |         |                   |                              |                            |                          |         | <b>11.888.696</b> | <b>0,53</b>                  |
| COLOMBIA (GOVT) 3,875 %    |                          |         |                   |                              | <b>ITALIEN</b>             |                          |         |                   |                              |
| 25.04.27                   | 8.300.000                | USD     | 7.828.205         | 0,35                         | UNIONE DI BANCHE           |                          |         |                   |                              |
|                            |                          |         | <b>7.828.205</b>  | <b>0,35</b>                  | ITALIANE 5,875 % VRN PERP  | 3.150.000                | EUR     | 3.395.767         | 0,15                         |
| <b>FRANKREICH</b>          |                          |         |                   |                              |                            |                          |         | <b>3.395.767</b>  | <b>0,15</b>                  |
| BPCE 0,53 % VRN 10.12.26   | 100.000.000              | JPY     | 653.638           | 0,03                         | <b>LUXEMBURG</b>           |                          |         |                   |                              |
| BPCE 5,975 % VRN           |                          |         |                   |                              | GRAND CITY PROPERTIES      |                          |         |                   |                              |
| 18.01.27                   | 2.667.000                | USD     | 2.675.851         | 0,12                         | 1,5 % VRN PERP             | 7.800.000                | EUR     | 5.445.548         | 0,24                         |
| CREDIT AGRICOLE 6,316 %    |                          |         |                   |                              | LOGICOR FINANCING 2,25 %   |                          |         |                   |                              |
| VRN 03.10.29               | 3.500.000                | USD     | 3.631.027         | 0,16                         | 13.05.25                   | 6.950.000                | EUR     | 7.338.471         | 0,33                         |
|                            |                          |         | <b>6.960.516</b>  | <b>0,31</b>                  | LOGICOR FINANCING SARL     |                          |         |                   |                              |
| <b>DEUTSCHLAND</b>         |                          |         |                   |                              | 0,625 % 17.11.25           | 2.206.000                | EUR     | 2.245.121         | 0,10                         |
| DEUTSCHE BANK 4 % VRN      |                          |         |                   |                              | MEXICO REMITTANCES         |                          |         |                   |                              |
| 24.06.32                   | 1.300.000                | EUR     | 1.361.836         | 0,06                         | FUNDING 4,875 % 15.01.2028 | 14.578.000               | USD     | 10.461.027        | 0,46                         |
| GERMANY (GOVT) 0,25 %      |                          |         |                   |                              |                            |                          |         | <b>25.490.167</b> | <b>1,13</b>                  |
| 15.02.27                   | 97.000.000               | EUR     | 98.242.225        | 4,37                         | <b>MAURITIUS</b>           |                          |         |                   |                              |
|                            |                          |         | <b>99.604.061</b> | <b>4,43</b>                  | NETWORK 5,65 % VRN PERP    | 4.000.000                | USD     | 3.972.086         | 0,18                         |
| <b>GROSSBRITANNIEN</b>     |                          |         |                   |                              |                            |                          |         | <b>3.972.086</b>  | <b>0,18</b>                  |
| ANGLO AMERICAN CAPITAL     |                          |         |                   |                              | <b>NIEDERLANDE</b>         |                          |         |                   |                              |
| 3,75 % 15.06.29            | 8.696.000                | EUR     | 9.405.300         | 0,41                         | CTP 0,5 % 21.06.25         | 2.711.000                | EUR     | 2.795.597         | 0,12                         |
| BARCLAYS 8,875 % VRN PERP  | 5.828.000                | GBP     | 7.510.363         | 0,33                         | DIGITAL DUTCH FINCO        |                          |         |                   |                              |
| HISCOX 6 % 22.09.27        | 1.375.000                | GBP     | 1.770.177         | 0,08                         | 0,625 % 15.07.25           | 2.000.000                | EUR     | 2.071.453         | 0,09                         |
| HSBC HOLDINGS PLC          |                          |         |                   |                              | IBERDROLA INTERNATIONAL    |                          |         |                   |                              |
| 5,887 % VRN 14.08.27       | 4.800.000                | USD     | 4.844.120         | 0,22                         | 1,874 % VRN PERP           | 7.900.000                | EUR     | 8.128.091         | 0,37                         |
| LLOYDS BANKING GROUP       |                          |         |                   |                              |                            |                          |         | <b>12.995.141</b> | <b>0,58</b>                  |
| 8,5 % VRN PERP             | 1.900.000                | GBP     | 2.453.199         | 0,11                         | <b>NEUSEELAND</b>          |                          |         |                   |                              |
| LLOYDS BANKING GROUP       |                          |         |                   |                              | WESTPAC NEW ZEALAND        |                          |         |                   |                              |
| PLC 5,985 % VRN 07.08.2027 | 3.384.000                | USD     | 3.418.038         | 0,15                         | 5,132 % 26.02.27           | 6.562.000                | USD     | 6.569.525         | 0,29                         |
| MACQUARIE AIRFINANCE       |                          |         |                   |                              |                            |                          |         | <b>6.569.525</b>  | <b>0,29</b>                  |
| HOLDINGS 6,4 % 26.03.29    | 2.000.000                | USD     | 2.032.710         | 0,09                         | <b>SERBIEN</b>             |                          |         |                   |                              |
| NATIONWIDE BUILDING        |                          |         |                   |                              | SERBIA (GOVT) 3,125 %      |                          |         |                   |                              |
| SOCIETY 5,875 % VRN PERP   | 3.500.000                | GBP     | 4.387.495         | 0,20                         | 15.05.27                   | 7.500.000                | EUR     | 7.793.972         | 0,35                         |
| NATWEST GROUP 5,583 %      |                          |         |                   |                              |                            |                          |         | <b>7.793.972</b>  | <b>0,35</b>                  |
| 01/03/2028                 | 5.950.000                | USD     | 5.985.332         | 0,27                         |                            |                          |         |                   |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Short Duration Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung              | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung                            | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---------------------------|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|---|--------------------------|---------|--------------------|------------------------------|
| <b>SÜDKOREA</b>           |                          |         |                   |                              | 15.01.27                                | 1.977.000                | USD     | 1.816.616          | 0,08                         |
| HYUNDAI CAPITAL           |                          |         |                   |                              |   |                          |         | <b>267.016.819</b> | <b>11,87</b>                 |
| SERVICES 5,125 % 05.02.27 | 8.784.000                | USD     | 8.724.331         | 0,39                         | <b>SUMME ANLEIHEN</b>                   |                          |         | <b>637.104.139</b> | <b>28,34</b>                 |
|                           |                          |         | <b>8.724.331</b>  | <b>0,39</b>                  | <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b> |                          |         |                    |                              |
| <b>SPANIEN</b>            |                          |         |                   |                              | <b>AUSTRALIEN</b>                       |                          |         |                    |                              |
| CAIXABANK 5,673 % VRN     |                          |         |                   |                              | SAPPHIRE TRUST FRN                      |                          |         |                    |                              |
| 15.03.30                  | 12.581.000               | USD     | 12.583.986        | 0,56                         | 16.08.54                                | 6.000.000                | AUD     | 2.863.475          | 0,13                         |
|                           |                          |         | <b>12.583.986</b> | <b>0,56</b>                  |   |                          |         | <b>2.863.475</b>   | <b>0,13</b>                  |
| <b>SCHWEDEN</b>           |                          |         |                   |                              | <b>CHINA</b>                            |                          |         |                    |                              |
| SWEDEN (GOVT) 1 %         |                          |         |                   |                              | ATRIUM FRN 23.01.2031                   | 1.500.000                | USD     | 1.506.086          | 0,07                         |
| 12/11/2026                | 80.000.000               | SEK     | 7.171.070         | 0,32                         |   |                          |         | <b>1.506.086</b>   | <b>0,07</b>                  |
|                           |                          |         | <b>7.171.070</b>  | <b>0,32</b>                  | <b>GROSSBRITANNIEN</b>                  |                          |         |                    |                              |
| <b>USA</b>                |                          |         |                   |                              | <b>IRLAND</b>                           |                          |         |                    |                              |
| AIRCASTLE 5,25 %          |                          |         |                   |                              | TWIN BRIDGES FRN                        |                          |         |                    |                              |
| 11/08/2025                | 5.060.000                | USD     | 5.015.679         | 0,22                         | 15.05.56                                | 2.300.000                | GBP     | 2.964.623          | 0,13                         |
| AIRCASTLE 5,95 %          |                          |         |                   |                              |   |                          |         | <b>2.964.623</b>   | <b>0,13</b>                  |
| 15.02.29                  | 6.146.000                | USD     | 6.158.453         | 0,27                         | <b>BARINGS EURO CLO DAC</b>             |                          |         |                    |                              |
| ATHENE GLOBAL FUNDING     |                          |         |                   |                              | FRN 24.07.32                            | 1.000.000                | EUR     | 1.026.419          | 0,05                         |
| 5,516 % 25.03.27          | 35.510.000               | USD     | 35.554.201        | 1,58                         | BERG FINANCE FRN                        |                          |         | 178.168            | 0,01                         |
| BANK OF AMERICA 1,978 %   |                          |         |                   |                              | 22.07.33                                | 1.000.000                | EUR     |                    |                              |
| VRN 15.09.27              | 3.000.000                | CAD     | 2.071.056         | 0,09                         | CONTEGO DAC FRN                         |                          |         | 802.174            | 0,04                         |
| BRISTOLMYERS SQUIBB       |                          |         |                   |                              | 14.05.32                                | 750.000                  | EUR     |                    |                              |
| 4,9 % 22.02.29            | 1.818.000                | USD     | 1.828.171         | 0,08                         | DILOSK RMBS FRN                         |                          |         |                    |                              |
| CAPITAL ONE FINANCIAL     |                          |         |                   |                              | 20.12.60                                | 1.750.000                | EUR     | 1.871.147          | 0,08                         |
| 7,149 % VRN 29.10.27      | 2.534.000                | USD     | 2.640.523         | 0,12                         | DILOSK RMBS FRN                         |                          |         | 2.666.446          | 0,12                         |
| CARRIER GLOBAL 5,8 %      |                          |         |                   |                              | 20.05.62                                | 2.468.000                | EUR     |                    |                              |
| 30.11.25                  | 6.176.000                | USD     | 6.221.548         | 0,28                         | ELM PARK CLO FRN                        |                          |         |                    |                              |
| COLUMBIA PIPELINES        |                          |         |                   |                              | 15.04.34                                | 2.000.000                | EUR     | 2.124.072          | 0,09                         |
| HOLDING 6,055 % 15.08.26  | 4.250.000                | USD     | 4.298.561         | 0,19                         | ELM PARK FRN 15.04.2034                 | 1.000.000                | EUR     | 1.065.687          | 0,05                         |
| FORD MOTOR CREDIT         |                          |         |                   |                              | FINANCE IRELAND RMBS                    |                          |         |                    |                              |
| 5,8 % 05.03.27            | 5.096.000                | USD     | 5.120.509         | 0,23                         | FRN 24.06.61                            | 1.000.000                | EUR     | 1.078.768          | 0,05                         |
| GENERAL MOTORS            |                          |         |                   |                              | FROST CMBS DAC FRN                      |                          |         |                    |                              |
| FINANCIAL 1,55 % 02.09.25 | 1.000.000                | AUD     | 618.859           | 0,03                         | 22.11.26                                | 1.000.000                | GBP     | 1.149.506          | 0,05                         |
| JACKSON NATIONAL LIFE     |                          |         |                   |                              | HARVEST FRN 20.10.2032                  | 5.000.000                | EUR     | 5.378.220          | 0,24                         |
| GLOBAL 5,25 % 12.04.28    | 12.800.000               | USD     | 12.670.916        | 0,56                         | INVESCO CLO FRN                         |                          |         |                    |                              |
| JPMORGAN CHASE BANK       |                          |         |                   |                              | 15.08.34                                | 6.500.000                | EUR     | 6.941.749          | 0,30                         |
| 5,11 % 08.12.26           | 15.000.000               | USD     | 15.051.758        | 0,67                         | INVESCO CLO FRN                         |                          |         |                    |                              |
| MOHAWK INDUSTRIES 5,85 %  |                          |         |                   |                              | 15.08.2034 (XS2369271130)               | 2.000.000                | EUR     | 2.105.663          | 0,09                         |
| 18.09.28                  | 2.752.000                | USD     | 2.837.205         | 0,13                         | INVESCO EURO CLO FRN                    |                          |         |                    |                              |
| NATIONAL GRID NORTH       |                          |         |                   |                              | 15.07.31                                | 2.500.000                | EUR     | 2.621.264          | 0,12                         |
| AMERICA 4,151 % 12.09.27  | 14.482.000               | EUR     | 15.914.474        | 0,71                         | INVESCO EURO CLO FRN                    |                          |         |                    |                              |
| SBA TOWER TRUST 1,884 %   |                          |         |                   |                              | 15.04.33                                | 793.000                  | EUR     | 842.931            | 0,04                         |
| 15.07.50                  | 600.000                  | USD     | 560.838           | 0,02                         | JUBILEE CLO FRN                         |                          |         |                    |                              |
| SK BATTERY AMERICA        |                          |         |                   |                              | 20.11.31                                | 2.500.000                | EUR     | 2.706.266          | 0,12                         |
| 4,875 % 23.01.27          | 2.800.000                | USD     | 2.776.059         | 0,12                         | JUBILEE CLO FRN                         |                          |         |                    |                              |
| US (GOVT) 1,50 %          |                          |         |                   |                              | 20.11.2031 (XS1980848169)               | 2.000.000                | EUR     | 2.169.173          | 0,10                         |
| 31.01.27                  | 97.750.000               | USD     | 90.216.377        | 4,01                         | LAST MILE LOGISTIC FRN                  |                          |         |                    |                              |
| US (GOVT) 1,875 %         |                          |         |                   |                              | 17.08.33                                | 953.000                  | EUR     | 969.183            | 0,04                         |
| 28.02.27                  | 12.200.000               | USD     | 11.362.203        | 0,51                         | LAST MILE LOGISTICS FRN                 |                          |         |                    |                              |
| US (GOVT) 2,25 %          |                          |         |                   |                              | 17.08.2026 (XS2356454913)               | 1.000.000                | EUR     | 1.022.919          | 0,05                         |
| 15.02.27                  | 47.000.000               | USD     | 44.282.813        | 1,97                         | LAST MILE SECURITIES                    |                          |         |                    |                              |
| WEA FINANCE 2,875 %       |                          |         |                   |                              | DAC FRN 17.08.31                        | 1.200.000                | EUR     | 1.256.019          | 0,06                         |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Short Duration Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|---|--------------------------|---------|-----------|------------------------------|
| LAST MILE SECURITIES FRN<br>17.08.31                  | 1.718.000                | EUR     | 1.819.070         | 0,08                         | APIDOS CLO XXXIX FRN<br>21.04.2035 (US03766HAJ95)               | 1.000.000                | USD     | 991.618   | 0,04                         |
| LAST MILE SECURITIES FRN<br>17.08.2031 (XS2320420875) | 1.950.000                | EUR     | 2.061.981         | 0,09                         | ARES XLV CLO FRN<br>15.10.30                                    | 2.000.000                | USD     | 2.003.762 | 0,09                         |
| LAST MILE SECURITIES FRN<br>17.08.2031 (XS2320420792) | 2.463.000                | EUR     | 2.642.870         | 0,12                         | BAIN CAPITAL CREDIT CLO<br>FRN 19.04.34                         | 2.000.000                | USD     | 1.996.528 | 0,09                         |
| PENTA CLO DAC FRN<br>17.12.30                         | 2.000.000                | EUR     | 2.147.559         | 0,10                         | BAMLL COMMERCIAL MORTGAGE<br>3,7157 % VRN 14.04.33              | 1.000.000                | USD     | 955.708   | 0,04                         |
| PENTA CLO FRN 20.04.2035                              | 1.000.000                | EUR     | 1.069.261         | 0,05                         | BAMLL MORTGAGE TRUST<br>3,218 % 14.04.33                        | 2.725.000                | USD     | 2.625.311 | 0,12                         |
| PENTA CLO FRN 20.04.2035<br>(XS2289567914)            | 2.500.000                | EUR     | 2.702.303         | 0,12                         | BAMLL MORTGAGE TRUST<br>3,5958 % VRN 14.04.33                   | 1.500.000                | USD     | 1.419.077 | 0,06                         |
| ST PAUL'S CLO FRN<br>22.04.35                         | 6.400.000                | EUR     | 6.822.626         | 0,29                         | BANC OF AMERICA MERRIL<br>3,49 % 14.04.33                       | 2.680.000                | USD     | 2.569.695 | 0,11                         |
| TAURUS DAC FRN 17.05.31                               | 2.279.000                | GBP     | 2.813.657         | 0,13                         | BBCMS MORTGAGE TRUST<br>FRN 15.03.37                            | 1.000.000                | USD     | 887.844   | 0,04                         |
| TAURUS FRN 17.05.2031                                 | 1.500.000                | GBP     | 1.872.782         | 0,08                         | BF MORTGAGE TRUST FRN<br>15.12.35                               | 1.285.000                | USD     | 1.081.104 | 0,05                         |
| TAURUS FRN 17.05.2031<br>(XS2303819929)               | 3.525.000                | GBP     | 4.339.152         | 0,19                         | BF NYT MORTGAGE TRUST<br>FRN 15.11.35                           | 455.000                  | USD     | 401.375   | 0,02                         |
|   |                          |         | <b>66.267.035</b> | <b>2,95</b>                  | BOYCE PARK CLO FRN<br>21.04.35                                  | 1.000.000                | USD     | 994.345   | 0,04                         |
| <b>ITALIEN</b>  |                          |         |                   |                              | BWAY MORTGAGE TRUST<br>3,4462 % 10.03.33                        | 830.000                  | USD     | 733.949   | 0,03                         |
| ERNA FRN 25.07.2031                                   | 3.900.000                | EUR     | 1.929.689         | 0,09                         | BWAY MORTGAGE TRUST<br>3,6332 % 10.03.33                        | 750.000                  | USD     | 654.599   | 0,03                         |
|   |                          |         | <b>1.929.689</b>  | <b>0,09</b>                  | BWAY MORTGAGE TRUST<br>3,927 % VRN 10.03.33                     | 1.000.000                | USD     | 850.442   | 0,04                         |
| <b>JERSEY</b>   |                          |         |                   |                              | BX TRUST FRN 25.11.2028   | 3.800.000                | USD     | 2.649.272 | 0,12                         |
| APIDOS CLO FRN 25.04.35                               | 1.605.000                | USD     | 1.627.261         | 0,07                         | BXP TRUST 3,4248 % VRN<br>13.06.39                              | 2.200.000                | USD     | 1.962.380 | 0,09                         |
|   |                          |         | <b>1.627.261</b>  | <b>0,07</b>                  | CAMB COMMERCIAL MORTGAGE<br>TRUST FRN 15.12.37                  | 4.163.000                | USD     | 4.164.160 | 0,18                         |
| <b>NIEDERLANDE</b>                                    |                          |         |                   |                              | CAMB COMMERCIAL MORTGAGE TRUST FRN<br>15.12.2037 (US12482HAN44) | 2.835.008                | USD     | 2.830.857 | 0,13                         |
| JUBILEE CLO FRN<br>15.04.35                           | 1.000.000                | EUR     | 1.065.942         | 0,05                         | CIFC FUNDING FRN<br>18.07.31                                    | 2.000.000                | USD     | 2.000.006 | 0,09                         |
|   |                          |         | <b>1.065.942</b>  | <b>0,05</b>                  | CIFC FUNDING FRN<br>17.10.31                                    | 1.000.000                | USD     | 999.965   | 0,04                         |
| <b>USA</b>  |                          |         |                   |                              | CIFC FUNDING FRN<br>17.10.2031 (US17181TAE10)                   | 1.500.000                | USD     | 1.502.726 | 0,07                         |
| 280 PARK AVENUE<br>MORTGAGE FRN 15.09.2034            | 3.000.000                | USD     | 2.902.253         | 0,13                         | CIFC FUNDING FRN<br>20.04.32                                    | 2.000.000                | USD     | 1.987.224 | 0,09                         |
| ALLEGANY PARK CLO FRN<br>20.01.35                     | 1.000.000                | USD     | 990.127           | 0,04                         | COMMERCIAL MORTGAGE<br>TRUST 2,056 % VRN 10.01.2038             | 3.900.000                | USD     | 3.363.105 | 0,15                         |
| AMERICAN HOMES 4 RENT<br>4,596 % 17.12.36             | 1.400.000                | USD     | 1.385.051         | 0,06                         | COMMERCIAL MORTGAGE<br>TRUST 2,321 % VRN 10.01.2038             | 670.000                  | USD     | 565.517   | 0,03                         |
| AMERICAN HOMES 4,295 %<br>17.10.52                    | 3.653.000                | USD     | 3.566.474         | 0,16                         | CONNECTICUT AVENUE FRN<br>25.10.41                              | 500.000                  | USD     | 502.360   | 0,02                         |
| AMERICAN HOMES 6,418 %<br>17.12.36                    | 1.200.000                | USD     | 1.199.903         | 0,05                         | CONNECTICUT AVENUE SECURITIES<br>TRUST FRN 25.01.44             | 1.000.000                | USD     | 1.006.865 | 0,04                         |
| AMMC CLO 21 FRN<br>02/11/2030                         | 2.300.000                | USD     | 2.288.707         | 0,10                         | CONNECTICUT AVENUE SECURITIES<br>TRUST FRN 25.02.44             | 2.500.000                | USD     | 2.473.670 | 0,11                         |
| AMMC CLO FRN<br>26.05.31                              | 1.000.000                | USD     | 994.136           | 0,04                         | CONNECTICUT AVENUE SECURITIES                                   |                          |         |           |                              |
| APIDOS CLO FRN<br>18.10.31                            | 2.000.000                | USD     | 1.997.806         | 0,09                         |   |                          |         |           |                              |
| APIDOS CLO FRN<br>15.04.33                            | 2.000.000                | USD     | 1.991.360         | 0,09                         |   |                          |         |           |                              |
| APIDOS CLO FRN 22.10.34                               | 2.000.000                | USD     | 1.994.790         | 0,09                         |   |                          |         |           |                              |
| APIDOS CLO XXVII FRN<br>17.07.30                      | 1.600.000                | USD     | 1.599.947         | 0,07                         |   |                          |         |           |                              |
| APIDOS CLO XXXI FRN<br>15.04.31                       | 2.000.000                | USD     | 1.994.638         | 0,09                         |   |                          |         |           |                              |
| APIDOS CLO XXXIX<br>FRN 21.04.35                      | 750.000                  | USD     | 735.371           | 0,03                         |   |                          |         |           |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Short Duration Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert  | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--------------------------|---------|-----------|------------------------------|---|--------------------------|---------|--------------------|------------------------------|
| TRUST FRN 25.06.43   | 2.000.000                | USD     | 1.707.689 | 0,08                         | MORGAN STANLEY CAPITAL  |                          |         |                    |                              |
| COOK PARK FRN 17.04.2030                                       | 1.000.000                | USD     | 993.857   | 0,04                         | FRN 15.12.38  | 500.000                  | USD     | 469.547            | 0,02                         |
| CORE MORTGAGE TRUST FRN<br>15.12.31                            | 1.500.000                | USD     | 1.112.293 | 0,05                         | NEUBERGER BERMAN CLO<br>FRN 15.01.30  | 2.000.000                | USD     | 1.983.988          | 0,09                         |
| DBCG MORTGAGE TRUST FRN<br>15.06.34                            | 8.000.000                | USD     | 8.020.397 | 0,37                         | NEUBERGER BERMAN CLO<br>FRN 18.10.30  | 2.500.000                | USD     | 2.484.123          | 0,11                         |
| DBGS MORTGAGE TRUST FRN<br>15.05.35                            | 2.500.000                | USD     | 2.261.186 | 0,10                         | NYT MORTGAGE TRUST FRN<br>15.11.35  | 2.000.000                | USD     | 1.880.619          | 0,08                         |
| DBGS MORTGAGE TRUST FRN<br>15.05.2035 (US23306GAC15)           | 2.000.000                | USD     | 1.816.959 | 0,08                         | PARK AVENUE MORTGAGE<br>FRN 15.09.34  | 1.110.000                | USD     | 1.090.092          | 0,05                         |
| DBGS MORTGAGE TRUST FRN<br>15.05.2035 (US23306GAE70)           | 2.000.000                | USD     | 1.813.644 | 0,08                         | PIKES PEAK CLO FRN<br>25.10.34  | 2.000.000                | USD     | 2.009.844          | 0,09                         |
| FANNIE MAE CONNECTICUT<br>AVENUE FRN 25.01.2030                | 1.445.000                | USD     | 1.474.898 | 0,07                         | PROGRESS RESIDENTIAL<br>1,558 % 17.05.38  | 2.000.000                | USD     | 1.841.743          | 0,08                         |
| FREDDIE MAC FRN<br>25.08.33                                    | 2.775.000                | USD     | 2.399.347 | 0,11                         | PROGRESS RESIDENTIAL<br>1,681 % 17.10.38  | 165.000                  | USD     | 149.661            | 0,01                         |
| FREDDIE MAC STACR REMIC<br>TRUST FRN 25.10.33                  | 2.200.000                | USD     | 1.324.211 | 0,05                         | PROGRESS RESIDENTIAL<br>1,808 % 17.05.38  | 2.230.000                | USD     | 2.056.203          | 0,09                         |
| FREDDIE MAC STACR REMIC<br>TRUST FRN 25.01.42                  | 4.010.000                | USD     | 2.710.377 | 0,12                         | PROGRESS RESIDENTIAL<br>2,039 % 17.05.38  | 1.120.000                | USD     | 1.033.687          | 0,05                         |
| FREDDIE MAC STACR REMIC<br>TRUST FRN 25.11.43                  | 500.000                  | USD     | 497.178   | 0,02                         | PROGRESS RESIDENTIAL<br>2,409 % 17.05.38  | 1.000.000                | USD     | 914.183            | 0,04                         |
| FREDDIE MAC STACR REMIC<br>TRUST FRN 25.02.44                  | 5.000.000                | USD     | 5.021.830 | 0,23                         | PROGRESS RESIDENTIAL<br>3,75 % 17.04.39   | 1.000.000                | USD     | 942.377            | 0,04                         |
| FREDDIE MAC STACR REMIC TRUST FRN<br>25.02.2044 (US35564NAW39) | 3.000.000                | USD     | 2.970.016 | 0,13                         | PROGRESS RESIDENTIAL<br>3,945 % 17.04.27  | 2.819.000                | USD     | 2.646.292          | 0,12                         |
| FREDDIE MAC STACR REMIC TRUST FRN<br>25.02.2044 (US35564NAX12) | 2.000.000                | USD     | 1.921.907 | 0,09                         | PROGRESS RESIDENTIAL<br>TRUST 1,855 % 17.07.38                                      | 2.175.000                | USD     | 1.985.420          | 0,09                         |
| FREDDIE MAC STRUCTURED<br>AGENCY FRN 25.02.2042                | 3.680.000                | USD     | 1.872.600 | 0,08                         | SMB PRIVATE EDUCATION<br>LOAN FRN 17.02.2032  | 4.448.000                | USD     | 329.911            | 0,01                         |
| FREDDIE MAC STRUCTURED<br>AGENCY FRN 25.04.43                  | 750.000                  | USD     | 654.091   | 0,03                         | SMB PRIVATE EDUCATION<br>LOAN TRUST FRN 15.05.2031                                  | 5.157.000                | USD     | 253.174            | 0,01                         |
| GALAXY CLO FRN 20.04.2031                                      | 1.244.000                | USD     | 1.242.614 | 0,06                         | TRICON AMERICAN HOMES<br>4,96 % 17.05.37  | 4.822.500                | USD     | 4.759.795          | 0,21                         |
| GALAXY XX CLO FRN<br>20.04.31                                  | 1.000.000                | USD     | 998.668   | 0,04                         | VANTAGE DATA CENTERS<br>1,645 % 15.09.45  | 1.750.000                | USD     | 1.639.912          | 0,07                         |
| GILBERT PARK CLO FRN<br>15.10.30                               | 1.000.000                | USD     | 1.002.151 | 0,04                         | VENTURE 28A CLO FRN<br>20.10.34   | 2.000.000                | USD     | 1.924.942          | 0,09                         |
| HPS LOAN MANAGEMENT FRN<br>22.01.35                            | 1.000.000                | USD     | 988.483   | 0,04                         | VNDO TRUST 3,9026 % VRN<br>10/01/2035   | 2.000.000                | USD     | 1.815.681          | 0,08                         |
| HUDSON YARDS MORTGAGE<br>2,835 % 10.08.38                      | 3.295.000                | USD     | 3.084.368 | 0,14                         | VOYA CLO FRN 18.10.2031   | 2.000.000                | USD     | 2.003.480          | 0,09                         |
| INDEPENDENCE PLAZA<br>TRUST 3,911 % 10.07.35                   | 2.500.000                | USD     | 2.374.197 | 0,11                         |   |                          |         | <b>162.445.471</b> | <b>7,22</b>                  |
| INVITATION HOMES TRUST<br>FRN 17.01.38                         | 2.237.452                | USD     | 1.890.488 | 0,08                         | <b>SUMME FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>                                       |                          |         | <b>240.669.582</b> | <b>10,71</b>                 |
| INVITATION HOMES TRUST FRN<br>17.01.2038 (US46187XAC92)        | 3.000.000                | USD     | 3.006.533 | 0,13                         | <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN<br/>MARKT GEHANDELTEN ÜBERTRAGBAREN WERTPAPIERE</b> |                          |         | <b>877.773.721</b> | <b>39,05</b>                 |
| INVITATION HOMES TRUST FRN<br>17.01.2038 (US46187XAE58)        | 4.750.000                | USD     | 4.762.293 | 0,22                         | <b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>  |                          |         |                    |                              |
| MADISON PARK FUNDING<br>FRN 15.07.30                           | 500.000                  | USD     | 493.209   | 0,02                         | <b>IRLAND</b>   |                          |         |                    |                              |
| MADISON PARK FUNDING<br>FRN 18.10.30                           | 2.000.000                | USD     | 2.001.286 | 0,09                         | HSBC US DOLLAR ESG<br>LIQUIDITY FUND Y INC  | 46.909.069               | USD     | 46.909.069         | 2,09                         |
|  |                          |         |           |                              |   |                          |         | <b>46.909.069</b>  | <b>2,09</b>                  |
|  |                          |         |           |                              | <b>SUMME ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>                                      |                          |         | <b>46.909.069</b>  | <b>2,09</b>                  |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Short Duration Bond (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung                                | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung          | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|--|--------------------------|------------------|------------------|------------------------------|
| <b>SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>    |                          |         |                   |                              | <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>                    |                          |                  |                  |                              |
| <b>ANLEIHEN</b>                             |                          |         |                   |                              | <b>AUSTRALIEN</b>  |                          |                  |                  |                              |
| <b>KANADA</b>                               |                          |         |                   |                              | LA TROBE FINANCIAL CAPITAL                                 |                          |                  |                  |                              |
| BANK OF MONTREAL 2,077 %<br>VRN 17.06.30    | 1.400.000                | CAD     | 997.235           | 0,04                         | MARKET FRN 14.10.54  | 4.500.000                | AUD              | 2.696.965        | 0,12                         |
| BANK OF MONTREAL 3,65 %<br>01/04/2027       | 11.000.000               | CAD     | 7.914.418         | 0,36                         | LA TROBE FINANCIAL CAPITAL<br>MARKET FRN 14.05.55          | 7.500.000                | AUD              | 4.928.195        | 0,22                         |
| BANK OF MONTREAL 6,034 %<br>VRN 07.09.33    | 10.000.000               | CAD     | 7.697.550         | 0,34                         |  |                          |                  | <b>7.625.160</b> | <b>0,34</b>                  |
| ROYAL BANK OF CANADA<br>2,88 % VRN 23.12.29 | 6.500.000                | CAD     | 4.720.996         | 0,21                         | <b>GROSSBRITANNIEN</b>                                     |                          |                  |                  |                              |
|   |                          |         | <b>21.330.199</b> | <b>0,95</b>                  | FINSBURY SQUARE FRN  |                          |                  |                  |                              |
| <b>FRANKREICH</b>                           |                          |         |                   |                              | 16.12.2067 (XS2352501105)                                  |                          |                  |                  |                              |
| BPCE 0,302 % 16.12.26                       | 200.000.000              | JPY     | 1.297.605         | 0,06                         | 2.500.000  | GBP                      | 3.135.918        | 0,14             |                              |
| BPCE 5,2018 % 29.09.25                      | 3.000.000                | AUD     | 1.961.467         | 0,09                         |  |                          | <b>3.135.918</b> | <b>0,14</b>      |                              |
| CREDIT AGRICOLE 0,514 %<br>VRN 06.07.27     | 1.100.000,00<br>0        | JPY     | 7.165.375         | 0,31                         | <b>IRLAND</b>  |                          |                  |                  |                              |
| CREDIT AGRICOLE 4,7 %<br>01/12/2025         | 1.700.000                | AUD     | 1.104.744         | 0,05                         | ATOM MORTGAGE  |                          |                  |                  |                              |
| CREDIT AGRICOLE 5,411 %<br>18.01.29         | 1.500.000                | AUD     | 994.933           | 0,04                         | SECURITIES FRN 22.07.31                                    |                          |                  |                  |                              |
| ELECTRICITE DE FRANCE<br>1,059 % 28.06.28   | 700.000.000              | JPY     | 4.616.314         | 0,21                         | ATOM MORTGAGE<br>SECURITIES FRN 22.07.31<br>(XS2373056634) |                          |                  |                  |                              |
|   |                          |         | <b>17.140.438</b> | <b>0,76</b>                  | 2.300.000  | GBP                      | 2.068.612        | 0,09             |                              |
| <b>GROSSBRITANNIEN</b>                      |                          |         |                   |                              | DILLIONS PARK FRN  |                          |                  |                  |                              |
| NATWEST MARKETS 5,899 %<br>23.08.28         | 10.300.000               | AUD     | 6.909.720         | 0,31                         | 15.10.2034 (XS2388463585)                                  | 1.000.000                | EUR              | 1.054.215        | 0,05                         |
|   |                          |         | <b>6.909.720</b>  | <b>0,31</b>                  | TAURUS CMBS FRN<br>17.08.2031 (XS2368104613)               | 1.200.000                | GBP              | 894.483          | 0,04                         |
| <b>NIEDERLANDE</b>                          |                          |         |                   |                              |  |                          |                  |                  |                              |
| ASR NEDERLAND 4,625 %<br>VRN PERP           | 4.100.000                | EUR     | 4.148.652         | 0,18                         | <b>USA</b>   |                          |                  |                  |                              |
|   |                          |         | <b>4.148.652</b>  | <b>0,18</b>                  | BXP TRUST 3,539 % VRN<br>13.06.39                          |                          |                  |                  |                              |
| <b>USA</b>                                  |                          |         |                   |                              | 2.000.000  |                          |                  |                  |                              |
| ATHENE GLOBAL FUNDING<br>2,1 % 24.09.25     | 2.000.000                | CAD     | 1.412.400         | 0,06                         | MADISON PARK FUNDING FRN<br>21.07.2030 (US55818YBJ91)      |                          |                  |                  |                              |
| BANK OF AMERICA 3,515 %<br>VRN 24.03.26     | 1.750.000                | CAD     | 1.272.904         | 0,06                         | 1.000.000  |                          |                  |                  |                              |
| GOLDMAN SACHS GROUP<br>2,013 % VRN 28.02.29 | 4.000.000                | CAD     | 2.672.150         | 0,12                         | 3.802.599  |                          |                  |                  |                              |
| MORGAN STANLEY 1,779 %<br>VRN 04.08.27      | 8.000.000                | CAD     | 5.514.522         | 0,25                         | <b>6.643.835</b>   |                          |                  |                  |                              |
| PAYPAL HOLDINGS 1,24 %<br>09/06/2028        | 200.000.000              | JPY     | 1.319.675         | 0,06                         | <b>0,29</b>  |                          |                  |                  |                              |
| PROLOGIS 4,7 % 01.03.2029                   | 10.000.000               | CAD     | 7.418.569         | 0,33                         | <b>SUMME FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>              |                          |                  |                  |                              |
|   |                          |         | <b>19.610.220</b> | <b>0,88</b>                  | <b>23.441.670</b>  |                          |                  |                  |                              |
| <b>SUMME ANLEIHEN</b>                       |                          |         |                   |                              | <b>1,04</b>  |                          |                  |                  |                              |
|   |                          |         | <b>69.139.229</b> | <b>3,08</b>                  | <b>SUMME SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>             |                          |                  |                  |                              |
|   |                          |         |                   |                              | <b>92.580.899</b>  |                          |                  |                  |                              |
|   |                          |         |                   |                              | <b>4,12</b>  |                          |                  |                  |                              |
|   |                          |         |                   |                              | <b>SUMME WERTPAPIERANLAGEN</b>                             |                          |                  |                  |                              |
|   |                          |         |                   |                              | <b>2.233.991.413</b>                                       |                          |                  |                  |                              |
|   |                          |         |                   |                              | <b>99,37</b>   |                          |                  |                  |                              |
|   |                          |         |                   |                              | <b>SONSTIGES NETTOVERMÖGEN</b>                             |                          |                  |                  |                              |
|   |                          |         |                   |                              | <b>14.062.907</b>  |                          |                  |                  |                              |
|   |                          |         |                   |                              | <b>0,63</b>  |                          |                  |                  |                              |
|   |                          |         |                   |                              | <b>GESAMTNETTOVERMÖGEN</b>                                 |                          |                  |                  |                              |
|   |                          |         |                   |                              | <b>2.248.054.320</b>                                       |                          |                  |                  |                              |
|   |                          |         |                   |                              | <b>100,00</b>  |                          |                  |                  |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

India Fixed Income

Aufstellung der Wertpapiieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert   | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung        | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert   | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|------------|------------------------------|---------------------|--------------------------|---------|------------|------------------------------|
| <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>  |                          |         |            |                              | INDIA (GOVT) 7,26 % |                          |         |            |                              |
| <b>AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |                          |         |            |                              | 06/02/2033          |                          |         |            |                              |
|   |                          |         |            |                              |                     | 3.250.000.000            | INR     | 39.420.887 | 4,92                         |
| <b>ANLEIHEN</b>   |                          |         |            |                              | INDIA (GOVT) 7,3 %  |                          |         |            |                              |
|   |                          |         |            |                              |                     | 4.500.000.000            | INR     | 55.181.125 | 6,90                         |
| <b>INDIEN</b>   |                          |         |            |                              | INDIA (GOVT) 7,32 % |                          |         |            |                              |
| BAJAJ FINANCE 0 %   |                          |         |            |                              |                     | 750.000.000              | INR     | 9.119.312  | 1,14                         |
| 18.02.26  | 350.000.000              | INR     | 4.642.806  | 0,58                         |                     |                          |         |            |                              |
| BAJAJ FINANCE 7,9 %   |                          |         |            |                              |                     | 1.750.000.000            | INR     | 21.533.399 | 2,69                         |
| 17.11.25  | 250.000.000              | INR     | 2.986.715  | 0,37                         |                     |                          |         |            |                              |
| EXPORT IMPORT BANK OF   |                          |         |            |                              |                     | 750.000.000              | INR     | 9.316.718  | 1,16                         |
| INDIA 2,25 % 13.01.31   | 8.000.000                | USD     | 6.622.179  | 0,83                         |                     |                          |         |            |                              |
| EXPORT IMPORT BANK OF   |                          |         |            |                              |                     | 500.000.000              | INR     | 5.984.374  | 0,75                         |
| INDIA 3,875 % 01.02.28  | 2.000.000                | USD     | 1.909.809  | 0,24                         |                     |                          |         |            |                              |
| HDFC BANK 5,686 %   |                          |         |            |                              |                     | 250.000.000              | INR     | 2.997.890  | 0,37                         |
| 02/03/2026  | 3.000.000                | USD     | 3.011.899  | 0,38                         |                     |                          |         |            |                              |
| HDFC BANK 7,7 % 18.11.2025  | 250.000.000              | INR     | 2.976.321  | 0,37                         |                     |                          |         |            |                              |
| HDFC BANK 7,8 % 06.09.32  | 250.000.000              | INR     | 2.999.741  | 0,37                         |                     |                          |         |            |                              |
| HDFC BANK 8 % 27.07.32  | 250.000.000              | INR     | 3.063.333  | 0,38                         |                     |                          |         |            |                              |
| HDFC BANK 8,44 %  |                          |         |            |                              |                     | 500.000.000              | INR     | 6.194.622  | 0,77                         |
| 28.12.28  | 1.000.000.000            | INR     | 12.275.094 | 1,53                         |                     |                          |         |            |                              |
| HDFC BANK 9 % 29.11.28  | 400.000.000              | INR     | 4.990.539  | 0,62                         |                     |                          |         |            |                              |
| HOUSING URBAN DEVELOPMENT 8,37 % 23.03.2029                       | 750.000.000              | INR     | 9.398.464  | 1,17                         |                     |                          |         |            |                              |
| HPCL MITTAL ENERGY 5,45 %   |                          |         |            |                              |                     | 250.000.000              | INR     | 2.995.821  | 0,37                         |
| 22.10.26  | 1.000.000                | USD     | 974.476    | 0,12                         |                     |                          |         |            |                              |
| INDIA (GOVT) 6,54 %   |                          |         |            |                              |                     | 250.000.000              | INR     | 2.983.598  | 0,37                         |
| 17.01.32  | 3.250.000.000            | INR     | 37.742.365 | 4,71                         |                     |                          |         |            |                              |
| INDIA (GOVT) 7,06 %   |                          |         |            |                              |                     | 1.000.000.000            | INR     | 12.005.102 | 1,50                         |
| 10/04/2028  | 2.750.000.000            | INR     | 32.983.548 | 4,12                         |                     |                          |         |            |                              |
| INDIA (GOVT) 7,1 %  |                          |         |            |                              |                     | 500.000.000              | INR     | 6.020.749  | 0,75                         |
| 18.04.29  | 3.000.000.000            | INR     | 36.078.992 | 4,50                         |                     |                          |         |            |                              |
| INDIA (GOVT) 7,17 %   |                          |         |            |                              |                     | 500.000.000              | INR     | 6.017.365  | 0,75                         |
| 17.04.30  | 3.500.000.000            | INR     | 42.194.127 | 5,28                         |                     |                          |         |            |                              |
| INDIA (GOVT) 7,18 %   |                          |         |            |                              |                     | 250.000.000              | INR     | 3.076.948  | 0,38                         |
| 14.08.33  | 2.750.000.000            | INR     | 33.278.876 | 4,15                         |                     |                          |         |            |                              |
| INDIA (GOVT) 7,18 %   |                          |         |            |                              |                     | 250.000.000              | INR     | 3.097.084  | 0,39                         |
| 24.07.37  | 7.000.000.000            | INR     | 84.646.854 | 10,58                        |                     |                          |         |            |                              |
| INDIA (GOVT) 7,25 %   |                          |         |            |                              |                     | 250.000.000              | INR     | 3.034.675  | 0,38                         |
| 12/06/2063  | 750.000.000              | INR     | 9.130.105  | 1,14                         |                     |                          |         |            |                              |
| INDIA (GOVT) 7,26 %   |                          |         |            |                              |                     | 250.000.000              | INR     | 3.082.039  | 0,38                         |
| 14.01.29  | 3.000.000.000            | INR     | 36.312.243 | 4,53                         |                     |                          |         |            |                              |
| INDIA (GOVT) 7,26 %   |                          |         |            |                              |                     | 13.000.000               | USD     | 11.318.695 | 1,41                         |
| 22.08.32  | 3.750.000.000            | INR     | 45.480.450 | 5,69                         |                     |                          |         |            |                              |
|   |                          |         |            |                              |                     | 5.000.000                | USD     | 4.626.370  | 0,58                         |
|   |                          |         |            |                              |                     | 9.000.000                | USD     | 8.251.512  | 1,03                         |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

India Fixed Income (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung                 | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------------------------|--------------------------|---------|--------------------|------------------------------|--|--------------------------|---------|--------------------|------------------------------|
| REC 2,25 % 01.09.26          | 5.000.000                | USD     | 4.620.490          | 0,58                         | <b>USA</b>   |                          |         |                    |                              |
| REC 2,75 % 13.01.27          | 5.000.000                | USD     | 4.639.067          | 0,58                         | PERIAMA HOLDINGS 5,95 %  |                          |         |                    |                              |
| REC 5,625 % 11.04.28         | 8.781.000                | USD     | 8.851.929          | 1,11                         | 19.04.26   | 2.000.000                | USD     | 1.977.896          | 0,25                         |
| RELIANCE INDUSTRIES          |                          |         |                    |                              |  |                          |         | <b>1.977.896</b>   | <b>0,25</b>                  |
| 8,65 % 11.12.28              | 500.000.000              | INR     | 6.240.092          | 0,78                         | <b>SUMME ANLEIHEN</b>  |                          |         | <b>749.061.217</b> | <b>93,51</b>                 |
| SMALL INDUSTRIES DEVELOPMENT |                          |         |                    |                              | <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN</b>                              |                          |         |                    |                              |
| BANK 7,54 % 12.01.26         | 500.000.000              | INR     | 5.963.032          | 0,74                         | <b>BÖRSE NOTIERTEN WERTPAPIERE</b>                               |                          |         | <b>749.061.217</b> | <b>93,51</b>                 |
| SMALL INDUSTRIES DEVELOPMENT |                          |         |                    |                              | <b>WERTPAPIERE</b>   |                          |         |                    |                              |
| BANK 7,55 % 22.09.26         | 500.000.000              | INR     | 5.967.444          | 0,74                         | <b>AN EINEM ANDEREM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE, ÜBERTRAGBARE</b> |                          |         |                    |                              |
| SMALL INDUSTRIES DEVELOPMENT |                          |         |                    |                              | <b>WERTPAPIERE</b>   |                          |         |                    |                              |
| BANK 7,83 % 24.11.2028       | 850.000.000              | INR     | 10.270.541         | 1,28                         | <b>ANLEIHEN</b>  |                          |         |                    |                              |
| STATE OF GUJARAT INDIA       |                          |         |                    |                              | <b>INDIEN</b>  |                          |         |                    |                              |
| 6,84 % 08.09.31              | 250.000.000              | INR     | 2.914.282          | 0,36                         | ADANI GREEN ENERGY 6,7 %   |                          |         |                    |                              |
| STATE OF GUJARAT INDIA       |                          |         |                    |                              | 12/03/2042   | 1.584.000                | USD     | 1.535.613          | 0,19                         |
| 6,95 % 14.07.31              | 200.000.000              | INR     | 2.347.403          | 0,29                         | HDFC BANK 3,7 % VRN PERP   | 5.400.000                | USD     | 4.982.459          | 0,62                         |
| STATE OF GUJARAT INDIA       |                          |         |                    |                              | HDFC BANK 5,196 %  |                          |         |                    |                              |
| 7,07 % 24.02.31              | 250.000.000              | INR     | 2.953.043          | 0,37                         | 15.02.27   | 1.286.000                | USD     | 1.278.071          | 0,16                         |
| STATE OF KARNATAKA           |                          |         |                    |                              | INDIAN RAILWAY FINANCE   |                          |         |                    |                              |
| INDIA 7,7 % 08.11.33         | 500.000.000              | INR     | 6.104.242          | 0,76                         | 2,8 % 10.02.31   | 8.000.000                | USD     | 6.799.086          | 0,85                         |
| STATE OF MAHARASHTRA         |                          |         |                    |                              | IRB INFRASTRUCTURE DEVE-   |                          |         |                    |                              |
| INDIA 6,78 % 25.05.31        | 500.000.000              | INR     | 5.808.870          | 0,73                         | LOPERS 7,11 % 11.03.32   | 1.130.000                | USD     | 1.147.469          | 0,14                         |
| STATE OF MAHARASHTRA         |                          |         |                    |                              | JSW STEEL 3,95 %   |                          |         |                    |                              |
| INDIA 6,8 % 16.06.31         | 250.000.000              | INR     | 2.903.477          | 0,36                         | 05/04/2027   | 1.500.000                | USD     | 1.396.344          | 0,17                         |
| STATE OF MAHARASHTRA         |                          |         |                    |                              | JSW STEEL 5,05 %   |                          |         |                    |                              |
| INDIA 7,71 % 08.11.33        | 250.000.000              | INR     | 3.063.414          | 0,38                         | 05/04/2032   | 2.000.000                | USD     | 1.763.576          | 0,22                         |
| STATE OF MAHARASHTRA         |                          |         |                    |                              | RELIANCE INDUSTRIES  |                          |         |                    |                              |
| INDIA 7,73 % 29.03.32        | 150.000.000              | INR     | 1.839.130          | 0,23                         | 3,625 % 12.01.52   | 17.300.000               | USD     | 12.569.083         | 1,57                         |
| STATE OF TAMIL NADU          |                          |         |                    |                              | SHRIRAM FINANCE 6,625 %  |                          |         |                    |                              |
| INDIA 6,95 % 07.07.31        | 250.000.000              | INR     | 2.931.455          | 0,37                         | 22.04.27   | 2.358.000                | USD     | 2.368.692          | 0,30                         |
| STATE OF TAMIL NADU          |                          |         |                    |                              |  |                          |         | <b>33.840.393</b>  | <b>4,22</b>                  |
| INDIA 6,98 % 14.07.31        | 500.000.000              | INR     | 5.873.318          | 0,73                         | <b>SUMME ANLEIHEN</b>  |                          |         | <b>33.840.393</b>  | <b>4,22</b>                  |
| TAMIL NADU (GOVT) 6,33 %     |                          |         |                    |                              | <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN</b>                              |                          |         |                    |                              |
| 22.07.30                     | 500.000.000              | INR     | 5.695.675          | 0,71                         | <b>MARKT GEHANDELTEN ÜBERTRAGBAREN WERTPAPIERE</b>               |                          |         | <b>33.840.393</b>  | <b>4,22</b>                  |
| TAMIL NADU (GOVT) 6,73 %     |                          |         |                    |                              | <b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>                         |                          |         |                    |                              |
| 13.05.30                     | 500.000.000              | INR     | 5.799.909          | 0,72                         | <b>IRLAND</b>  |                          |         |                    |                              |
| TATA CAPITAL 8,098 %         |                          |         |                    |                              | HSBC GLOBAL LIQUIDITY  |                          |         |                    |                              |
| 22.01.27                     | 500.000.000              | INR     | 5.975.094          | 0,75                         | FUND   | 369.099                  | USD     | 369.099            | 0,05                         |
|                              |                          |         | <b>742.606.981</b> | <b>92,70</b>                 |  |                          |         | <b>369.099</b>     | <b>0,05</b>                  |
| <b>SINGAPUR</b>              |                          |         |                    |                              | <b>SUMME ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>                   |                          |         | <b>369.099</b>     | <b>0,05</b>                  |
| ABJA INVESTMENT 5,95 %       |                          |         |                    |                              | <b>SUMME WERTPAPIERANLAGEN</b>                                   |                          |         | <b>783.270.709</b> | <b>97,78</b>                 |
| 31.07.24                     | 2.000.000                | USD     | 1.998.061          | 0,25                         | <b>SONSTIGES NETTOVERMÖGEN</b>                                   |                          |         | <b>17.802.989</b>  | <b>2,22</b>                  |
| TML HOLDINGS 4,35 %          |                          |         |                    |                              | <b>GESAMTNETTOVERMÖGEN</b>                                       |                          |         | <b>801.073.698</b> | <b>100,00</b>                |
| 09/06/2026                   | 500.000                  | USD     | 481.016            | 0,06                         |  |                          |         |                    |                              |
| TML HOLDINGS 5,5 %           |                          |         |                    |                              |  |                          |         |                    |                              |
| 03/06/2024                   | 2.000.000                | USD     | 1.997.263          | 0,25                         |  |                          |         |                    |                              |
|                              |                          |         | <b>4.476.340</b>   | <b>0,56</b>                  |  |                          |         |                    |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

RMB Fixed Income

Aufstellung der Wertpapiieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung  | Nennwert   | Währung | Kurswert         | % des Nettovermögens | Beschreibung   | Nennwert | Währung | Kurswert | % des Nettovermögens |
|---|------------|---------|------------------|----------------------|--|----------|---------|----------|----------------------|
| <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>  |            |         |                  |                      | <b>GREENTOWN CHINA</b>                               |          |         |          |                      |
| <b>AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |            |         |                  |                      | HOLDINGS 5,65 % 13.07.25                             |          |         |          |                      |
| <b>ANLEIHEN</b>   |            |         |                  |                      | INDUSTRIAL COMMERCIAL BANK OF CHINA 4,2 % 24.09.2030 |          |         |          |                      |
| <b>AUSTRALIEN</b>   |            |         |                  |                      | JDCOM 4,125 % 14.01.50                               |          |         |          |                      |
| NATIONAL AUSTRALIA BANK   |            |         |                  |                      | LONGFOR PROPERTIES 4,5 %                             |          |         |          |                      |
| 3,03 % 21.07.26   | 15.000.000 | CNY     | 2.065.135        | 0,94                 | 16.01.28   |          |         |          |                      |
|   |            |         | <b>2.065.135</b> | <b>0,94</b>          | MODERN LAND CHINA 2 %                                |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | 28.12.24   |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | MODERN LAND CHINA 9 %                                |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | 30.12.27   |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | WENS FOODSTUFFS GROUP                                |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | 2,349 % 29.10.25                                     |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | WEST CHINA CEMENT 4,95 %                             |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | 08/07/2026   |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | WYNN MACAU 4,875 %                                   |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | 01/10/2024   |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | YUNDA HOLDING INVESTMENT                             |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | 2,25 % 19.08.25                                      |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | ZHONGSHENG GROUP                                     |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | HOLDINGS 3 % 13.01.26                                |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | <b>41.540.158</b>                                    |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | <b>18,97</b>   |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | <b>FRANKREICH</b>                                    |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | BPCE 3,5 % 14.12.26                                  |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | 20.000.000   |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | CNY  |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | 2.758.110  |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | 1,26   |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | SOCIETE GENERALE 3,55 %                              |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | 16.06.29   |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | 7.000.000  |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | CNY  |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | 925.536  |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | 0,42   |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | SOCIETE GENERALE 4 %                                 |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | 19.07.24   |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | 23.000.000   |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | CNY  |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | 3.173.088  |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | 1,45   |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | <b>6.856.734</b>                                     |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | <b>3,13</b>  |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | <b>GROSSBRITANNIEN</b>                               |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | BARCLAYS BANK 3,7 %                                  |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | 09/09/2024   |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | 5.000.000  |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | CNY  |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | 690.164  |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | 0,32   |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | BARCLAYS BANK 4 %                                    |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | 21.07.25   |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | 20.000.000   |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | CNY  |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | 2.786.281  |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | 1,27   |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | <b>3.476.445</b>                                     |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | <b>1,59</b>  |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | <b>HONGKONG</b>                                      |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | AIA GROUP 2,7 % VRN PERP                             |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | 350.000  |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | USD  |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | 326.949  |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | 0,15   |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | BANK OF EAST ASIA                                    |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | 4,875 % VRN 22.04.32                                 |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | 250.000  |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | USD  |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | 235.052  |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | 0,11   |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | BANK OF EAST ASIA                                    |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | 6,625 % VRN 13.03.27                                 |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | 562.000  |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | USD  |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | 567.078  |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | 0,26   |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | CAS CAPITAL 4 % VRN PERP                             |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | 250.000  |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | USD  |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | 229.047  |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | 0,10   |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | CHAMPION PATH HOLDINGS                               |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | 4,5 % 27.01.26                                       |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | 500.000  |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | USD  |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | 476.724  |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | 0,22   |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | CHINA OVERSEAS GRAND OCEANS                          |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | FINANCE 2,45 % 09.02.26                              |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | 350.000  |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | USD  |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | 307.539  |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | 0,14   |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | ELECT GLOBAL INVESTMENTS                             |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | 4,10 % VRN PERP                                      |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | 200.000  |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | USD  |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | 182.507  |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | 0,08   |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | FORTUNE STAR 5 %                                     |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | 18.05.26   |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | 800.000  |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | USD  |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | 689.970  |          |         |          |                      |
|   |            |         |                  |                      | 0,31   |          |         |          |                      |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

RMB Fixed Income (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung                                       | Nennwert   | Währung | Kurswert          | % des Nettovermögens | Beschreibung                                   | Nennwert   | Währung | Kurswert          | % des Nettovermögens |
|--|------------|---------|-------------------|----------------------|--|------------|---------|-------------------|----------------------|
| HONG KONG (GOVT) 3,3 %<br>07/06/2033               | 9.320.000  | CNY     | 1.338.797         | 0,60                 | <b>JAPAN</b>                                   |            |         |                   |                      |
| HUARONG FINANCE 2019<br>3,25 % 13.11.24            | 290.000    | USD     | 284.077           | 0,13                 | FUKOKU MUTUAL LIFE<br>INSURANCE 6,8 % VRN PERP | 200.000    | USD     | 210.956           | 0,10                 |
| LENOVO GROUP 5,875 %<br>24.04.25                   | 400.000    | USD     | 400.620           | 0,18                 | MIZUHO FINANCIAL 5,579 %<br>26.05.35           | 200.000    | USD     | 202.757           | 0,09                 |
| LINK FINANCE CAYMAN<br>3,25 % 27.10.24             | 37.000.000 | CNY     | 5.098.424         | 2,32                 | RAKUTEN GROUP 11,25 %<br>15.02.27              | 200.000    | USD     | 212.034           | 0,10                 |
| LS FINANCE 4,8 %<br>18.06.26                       | 200.000    | USD     | 176.747           | 0,08                 |  |            |         | <b>625.747</b>    | <b>0,29</b>          |
| MELCO RESORTS FINANCE<br>5,25 % 26.04.26           | 300.000    | USD     | 289.481           | 0,13                 | <b>MACAU</b>                                   |            |         |                   |                      |
| MELCO RESORTS FINANCE<br>5,75 % 21.07.28           | 200.000    | USD     | 189.462           | 0,09                 | MGM CHINA HOLDINGS<br>4,75 % 01.02.27          | 202.000    | USD     | 192.719           | 0,09                 |
| NAN FUNG TREASURY<br>3,625 % 27.08.30              | 271.000    | USD     | 235.520           | 0,11                 |  |            |         | <b>192.719</b>    | <b>0,09</b>          |
| NAN FUNG TREASURY<br>3,875 % 03.10.27              | 250.000    | USD     | 231.408           | 0,11                 | <b>MALAYSIA</b>                                |            |         |                   |                      |
| NWD FINANCE 6,15 % VRN<br>PERP                     | 244.000    | USD     | 215.228           | 0,10                 | MALAYAN BANKING 3,55 %<br>09/06/2025           | 25.000.000 | CNY     | 3.458.539         | 1,58                 |
| NWD FINANCE 6,25 % PERP                            | 200.000    | USD     | 110.685           | 0,05                 |  |            |         | <b>3.458.539</b>  | <b>1,58</b>          |
| NWD MTN 4,125 % 18.07.2029                         | 200.000    | USD     | 153.615           | 0,07                 | <b>MONGOLEI</b>                                |            |         |                   |                      |
| NWD MTN 4,5 % 19.05.30                             | 200.000    | USD     | 151.197           | 0,07                 | MONGOLIA (GOVT) 7,875 %<br>05/06/2029          | 235.000    | USD     | 243.259           | 0,11                 |
| RKPF OVERSEAS 6,7 %<br>30.09.24                    | 200.000    | USD     | 124.576           | 0,06                 |  |            |         | <b>243.259</b>    | <b>0,11</b>          |
| SHUI ON DEVELOPMENT<br>HOLDING 6,15 % 24.08.24     | 200.000    | USD     | 176.348           | 0,08                 | <b>PHILIPPINEN</b>                             |            |         |                   |                      |
| STUDIO CITY FINANCE 6 %<br>15.07.25                | 300.000    | USD     | 295.819           | 0,14                 | METROPOLITAN BANK 5,5 %<br>06/03/2034          | 563.000    | USD     | 564.455           | 0,26                 |
| STUDIO CITY FINANCE<br>6,5 % 15.01.28              | 200.000    | USD     | 190.723           | 0,09                 |  |            |         | <b>564.455</b>    | <b>0,26</b>          |
| SWIRE PROPERTIES MTN<br>FINANCING 3,3 % 25.07.25   | 7.550.000  | CNY     | 1.041.622         | 0,48                 | <b>KATAR</b>                                   |            |         |                   |                      |
| SWIRE PROPERTIES MTN<br>FINANCING 3,55 % 25.07.28  | 7.410.000  | CNY     | 1.025.289         | 0,47                 | QNB FINANCE 3,15 %<br>04/02/2026               | 47.000.000 | CNY     | 6.454.089         | 2,96                 |
| WHARF REIC FINANCE 3,7 %<br>16.07.25               | 8.000.000  | CNY     | 1.109.670         | 0,50                 | QNB FINANCE 3,5 %<br>22.04.24                  | 5.000.000  | CNY     | 688.739           | 0,31                 |
| XIAOMI BEST TIME INTERNATIONAL<br>2,875 % 14.07.31 | 200.000    | USD     | 166.757           | 0,08                 | QNB FINANCE 3,6 %<br>05/06/2025                | 30.000.000 | CNY     | 4.148.494         | 1,89                 |
|  |            |         | <b>16.020.931</b> | <b>7,31</b>          | QNB FINANCE 3,82 %<br>06/02/2025               | 7.000.000  | CNY     | 970.707           | 0,44                 |
| <b>INDIEN</b>                                      |            |         |                   |                      |  |            |         | <b>12.262.029</b> | <b>5,60</b>          |
| EXPORTIMPORT BANK OF<br>INDIA 3,45 % 25.06.26      | 50.000.000 | CNY     | 6.905.739         | 3,16                 | <b>SINGAPUR</b>                                |            |         |                   |                      |
| JSW INFRASTRUCTURE<br>4,95 % 21.01.29              | 400.000    | USD     | 376.279           | 0,17                 | DBS GROUP HOLDINGS 3,7 %<br>03/03/2031         | 32.210.000 | CNY     | 4.488.251         | 2,05                 |
| RENEW WIND ENERGY 4,5 %<br>14.07.28                | 200.000    | USD     | 183.047           | 0,08                 | MEDCO MAPLE TREE 8,96 %<br>27.04.29            | 250.000    | USD     | 260.481           | 0,12                 |
|  |            |         | <b>7.465.065</b>  | <b>3,41</b>          | TEMASEK FINANCIAL 3,2 %<br>06/02/2029          | 19.210.000 | CNY     | 2.691.944         | 1,23                 |
| <b>IRLAND</b>                                      |            |         |                   |                      | TEMASEK FINANCIAL 3,4 %<br>27.03.44            | 50.000.000 | CNY     | 6.908.095         | 3,15                 |
| AVOLON HOLDINGS FUNDING<br>5,75 % 01.03.29         | 230.000    | USD     | 229.427           | 0,10                 | UNITED OVERSEAS BANK<br>4,5 % 06.04.32         | 50.000.000 | CNY     | 7.160.171         | 3,27                 |
|  |            |         | <b>229.427</b>    | <b>0,10</b>          |  |            |         | <b>21.508.942</b> | <b>9,82</b>          |
|  |            |         |                   |                      | <b>SÜDKOREA</b>                                |            |         |                   |                      |
|  |            |         |                   |                      | EXPORTIMPORT BANK OF<br>KOREA 3 % 07.08.26     | 6.000.000  | CNY     | 826.416           | 0,37                 |
|  |            |         |                   |                      | POSCO 4,875 % 23.01.27                         | 200.000    | USD     | 197.612           | 0,09                 |
|  |            |         |                   |                      | SHINHAN CARD 5,5 %<br>12/03/2029               | 515.000    | USD     | 518.634           | 0,24                 |
|  |            |         |                   |                      |  |            |         | <b>1.542.662</b>  | <b>0,70</b>          |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

RMB Fixed Income (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung   | Nennwert   | Währung | Kurswert           | % des Nettovermögens | Beschreibung                                       | Nennwert   | Währung | Kurswert          | % des Nettovermögens |
|--|------------|---------|--------------------|----------------------|--|------------|---------|-------------------|----------------------|
| <b>VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE</b>                              |            |         |                    |                      | <b>GROSSBRITANNIEN</b>                             |            |         |                   |                      |
| EMIRATES NBD BANK 3,32 %<br>19.02.26                             | 20.880.000 | CNY     | 2.878.617          | 1,31                 | STANDARD CHARTERED<br>7,875 % VRN PERP             | 4.405.000  | USD     | 4.398.877         | 2,01                 |
| EMIRATES NBD BANK 4 %<br>18.11.25                                | 7.000.000  | CNY     | 972.965            | 0,44                 |  |            |         | <b>4.398.877</b>  | <b>2,01</b>          |
| FIRST ABU DHABI BANK<br>3,15 % 29.01.26                          | 29.780.000 | CNY     | 4.092.481          | 1,87                 | <b>HONGKONG</b>                                    |            |         |                   |                      |
| FIRST ABU DHABI BANK<br>3,4 % 18.08.25                           | 12.000.000 | CNY     | 1.658.901          | 0,76                 | AIA GROUP 5,375 %<br>05/04/2034                    | 1.185.000  | USD     | 1.186.543         | 0,54                 |
|  |            |         | <b>9.602.964</b>   | <b>4,38</b>          | HKCG FINANCE 3,2 %<br>03/02/2026                   | 10.000.000 | CNY     | 1.381.026         | 0,63                 |
| <b>USA</b>   |            |         |                    |                      | HKCG FINANCE 3,74 %<br>28.03.25                    | 25.000.000 | CNY     | 3.459.293         | 1,58                 |
| PROLOGIS 3,5 % 06.02.27  | 20.000.000 | CNY     | 2.760.989          | 1,26                 | NEW WORLD CHINA LAND<br>4,75 % 23.01.27            | 200.000    | USD     | 177.763           | 0,08                 |
|  |            |         | <b>2.760.989</b>   | <b>1,26</b>          | SUN HUNG KAI PROPERTIES<br>CAPITAL 3,16 % 25.01.28 | 15.000.000 | CNY     | 2.047.867         | 0,93                 |
| <b>SUMME ANLEIHEN</b>  |            |         | <b>135.953.209</b> | <b>62,07</b>         | SUN HUNG KAI PROPERTIES<br>CAPITAL 3,2 % 14.08.27  | 37.000.000 | CNY     | 5.092.942         | 2,33                 |
| <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN</b>                              |            |         |                    |                      |  |            |         | <b>13.345.434</b> | <b>6,09</b>          |
| <b>BÖRSE NOTIERTEN WERTPAPIERE</b>                               |            |         | <b>135.953.209</b> | <b>62,07</b>         | <b>INDIEN</b>                                      |            |         |                   |                      |
| <b>WERTPAPIERE</b>   |            |         |                    |                      | SHRIRAM FINANCE 6,625 %<br>22.04.27                | 222.000    | USD     | 223.007           | 0,10                 |
| <b>AN EINEM ANDEREM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE, ÜBERTRAGBARE</b> |            |         |                    |                      |  |            |         | <b>223.007</b>    | <b>0,10</b>          |
| <b>WERTPAPIERE</b>   |            |         |                    |                      | <b>INDONESIEN</b>                                  |            |         |                   |                      |
| <b>ANLEIHEN</b>  |            |         |                    |                      | FREEPORT INDONESIA 6,2 %<br>14.04.52               | 230.000    | USD     | 229.151           | 0,10                 |
| <b>KANADA</b>  |            |         |                    |                      |  |            |         | <b>229.151</b>    | <b>0,10</b>          |
| ROYAL BANK OF CANADA<br>4,1 % 16.06.25                           | 22.000.000 | CNY     | 3.063.536          | 1,40                 | <b>MACAU</b>                                       |            |         |                   |                      |
|  |            |         | <b>3.063.536</b>   | <b>1,40</b>          | MGM CHINA HOLDINGS<br>5,25 % 18.06.25              | 200.000    | USD     | 197.289           | 0,09                 |
| <b>CHINA</b>   |            |         |                    |                      | SANDS CHINA 5,4 %<br>08/08/2028                    | 200.000    | USD     | 196.275           | 0,09                 |
| AGRICULTURAL<br>DEVELOPMENT BANK 3,1 %<br>27.02.33               | 24.000.000 | CNY     | 3.463.482          | 1,58                 |  |            |         | <b>393.564</b>    | <b>0,18</b>          |
| AGRICULTURAL DEVELOPMENT<br>BANK OF 2,63 % 07.06.2028            | 22.000.000 | CNY     | 3.068.081          | 1,40                 | <b>MALAYSIA</b>                                    |            |         |                   |                      |
| AGRICULTURAL DEVELOPMENT<br>BANK OF 2,97 % 14.10.32              | 35.000.000 | CNY     | 4.994.735          | 2,28                 | MALAYAN BANKING 2,8 %<br>23.06.24                  | 20.000.000 | CNY     | 2.760.868         | 1,26                 |
| AGRICULTURAL DEVELOPMENT<br>BANK OF 3,3 % 05.11.31               | 8.000.000  | CNY     | 1.164.081          | 0,53                 |  |            |         | <b>2.760.868</b>  | <b>1,26</b>          |
| CHINA(GOVT) 3,32 %<br>15.04.52                                   | 62.000.000 | CNY     | 9.720.991          | 4,44                 | <b>NIEDERLANDE</b>                                 |            |         |                   |                      |
| CHINA DEVELOPMENT BANK<br>2,63 % 08.01.34                        | 3.500.000  | CNY     | 491.034            | 0,22                 | PROSUS 4,987 % 19.01.52                            | 320.000    | USD     | 236.186           | 0,11                 |
| CHINA DEVELOPMENT BANK<br>3,07 % 10.03.30                        | 1.000.000  | CNY     | 142.742            | 0,07                 |  |            |         | <b>236.186</b>    | <b>0,11</b>          |
| CHINA DEVELOPMENT BANK<br>3,7 % 20.10.30                         | 2.500.000  | CNY     | 370.184            | 0,17                 | <b>KATAR</b>                                       |            |         |                   |                      |
| CHINA DEVELOPMENT BANK<br>4,04 % 06.07.28                        | 37.000.000 | CNY     | 5.453.551          | 2,49                 | QNB FINANCE 3,4 %<br>22.02.25                      | 10.000.000 | CNY     | 1.373.982         | 0,63                 |
| EXPORT IMPORT BANK OF<br>CHINA 3,38 % 16.07.31                   | 44.000.000 | CNY     | 6.425.314          | 2,93                 |  |            |         | <b>1.373.982</b>  | <b>0,63</b>          |
|  |            |         | <b>35.294.195</b>  | <b>16,11</b>         | <b>USA</b>   |            |         |                   |                      |
| <b>FRANKREICH</b>  |            |         |                    |                      | BROADCOM 3,137 %<br>15.11.35                       | 400.000    | USD     | 323.542           | 0,15                 |
| BNP PARIBAS 3,5 % VRN<br>20.03.30                                | 22.000.000 | CNY     | 3.032.957          | 1,38                 |  |            |         | <b>323.542</b>    | <b>0,15</b>          |
|  |            |         | <b>3.032.957</b>   | <b>1,38</b>          | <b>SUMME ANLEIHEN</b>                              |            |         | <b>64.675.299</b> | <b>29,52</b>         |
|  |            |         |                    |                      | <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN</b>                |            |         | <b>64.675.299</b> | <b>29,52</b>         |
|  |            |         |                    |                      | <b>MARKT GEHANDELTEN ÜBERTRAGBAREN WERTPAPIERE</b> |            |         |                   |                      |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

RMB Fixed Income (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung                                      | Nennwert   | Währung | Kurswert           | % des Nettovermögens |
|---|------------|---------|--------------------|----------------------|
| <b>SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>          |            |         |                    |                      |
| <b>ANLEIHEN</b>                                   |            |         |                    |                      |
| <b>CHINA</b>                                      |            |         |                    |                      |
| REDCO PROPERTIES GROUP<br>9,9 % 17.02.2024*       | 277.000    | USD     | 2.809              | 0,00                 |
|   |            |         | <b>2.809</b>       | <b>0,00</b>          |
| <b>HONGKONG</b>                                   |            |         |                    |                      |
| HENDERSON LAND 3,4 %<br>16.01.26                  | 20.000.000 | CNY     | 2.747.480          | 1,25                 |
| HYSAN MTN 3,15 %<br>13.06.26                      | 27.000.000 | CNY     | 3.680.292          | 1,68                 |
| SUN HUNG KAI PROPERTIES<br>CAPITAL 3,4 % 30.06.33 | 10.000.000 | CNY     | 1.362.574          | 0,62                 |
| SWIRE PROPERTIES MTN<br>FINANCING 3 % 06.06.26    | 15.000.000 | CNY     | 2.056.609          | 0,94                 |
| SWIRE PROPERTIES MTN<br>FINANCING 3,4 % 18.01.26  | 20.000.000 | CNY     | 2.765.552          | 1,26                 |
|   |            |         | <b>12.612.507</b>  | <b>5,75</b>          |
| <b>SÜDKOREA</b>                                   |            |         |                    |                      |
| EXPORTIMPORT BANK OF<br>KOREA 3,01 % 26.06.26     | 19.000.000 | CNY     | 2.618.344          | 1,20                 |
|   |            |         | <b>2.618.344</b>   | <b>1,20</b>          |
| <b>SUMME ANLEIHEN</b>                             |            |         | <b>15.233.660</b>  | <b>6,95</b>          |
| <b>SUMME SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>    |            |         | <b>15.233.660</b>  | <b>6,95</b>          |
| <b>SUMME WERTPAPIERANLAGEN</b>                    |            |         | <b>215.862.168</b> | <b>98,54</b>         |
| <b>SONSTIGES NETTOVERMÖGEN</b>                    |            |         | <b>3.192.044</b>   | <b>1,46</b>          |
| <b>GESAMTNETTOVERMÖGEN</b>                        |            |         | <b>219.054.212</b> | <b>100,00</b>        |

\* Der Vermögenswert, der am 17. Februar 2024 fällig war, ist notleidend. Der Ausschuss für die Preisbestimmung und die Verwaltungsgesellschaft haben vereinbart und veranlasst, den beizulegenden Zeitwert des Wertpapiers auf 2.809 USD festzusetzen.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Singapore Dollar Income Bond  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in SGD)

| Beschreibung  | Nennwert  | Währung | Kurswert          | % des Nettovermögens | Beschreibung                                   | Nennwert  | Währung | Kurswert          | % des Nettovermögens |
|---|-----------|---------|-------------------|----------------------|--|-----------|---------|-------------------|----------------------|
| <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>  |           |         |                   |                      | BNP PARIBAS 5,9 % VRN PERP                     | 3.000.000 | SGD     | 3.019.280         | 1,20                 |
| <b>AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |           |         |                   |                      | BPCE 5 % VRN 08.03.34                          | 3.500.000 | SGD     | 3.504.094         | 1,40                 |
| <b>ANLEIHEN</b>   |           |         |                   |                      | CREDIT AGRICOLE 4,85 % VRN 27.02.33            | 3.000.000 | SGD     | 3.017.663         | 1,20                 |
| <b>AUSTRALIEN</b>   |           |         |                   |                      | CREDIT AGRICOLE 5,25 % VRN 07.09.33            | 2.000.000 | SGD     | 2.050.207         | 0,82                 |
| AUSTRALIA NEW ZEALAND BANKING 4,5 % VRN 02.12.2032                | 2.000.000 | SGD     | 2.021.264         | 0,81                 |  |           |         | <b>15.130.852</b> | <b>6,03</b>          |
| WESTPAC BANKING 2,894 % VRN 04.02.30                              | 800.000   | USD     | 1.050.827         | 0,42                 | <b>DEUTSCHLAND</b>                             |           |         |                   |                      |
| WESTPAC BANKING 4,65 % VRN 07.09.32                               | 2.000.000 | SGD     | 2.034.199         | 0,80                 | COMMERZBANK 5,7 % VRN 03/05/2033               | 2.000.000 | SGD     | 2.038.481         | 0,81                 |
|   |           |         | <b>5.106.290</b>  | <b>2,03</b>          | COMMERZBANK 6,5 % VRN 24.04.34                 | 4.750.000 | SGD     | 4.937.204         | 1,97                 |
| <b>CHINA</b>  |           |         |                   |                      |  |           |         | <b>6.975.685</b>  | <b>2,78</b>          |
| CHALCO HONG KONG INVESTMENT 2,1 % 28.07.26                        | 592.000   | USD     | 742.269           | 0,30                 | <b>GROSSBRITANNIEN</b>                         |           |         |                   |                      |
| CHINA HONGQIAO GROUP 6,25 % 08.06.24                              | 400.000   | USD     | 539.032           | 0,21                 | BARCLAYS 7,3 % VRN PERP 29.11.28               | 1.750.000 | SGD     | 1.767.471         | 0,70                 |
| CHINA HONGQIAO GROUP 7,75 % 27.03.25                              | 496.000   | USD     | 672.277           | 0,27                 | BARCLAYS 8,3 % VRN PERP IHS HOLDING 6,25 %     | 3.500.000 | SGD     | 3.651.735         | 1,46                 |
| CHINA MODERN DAIRY HOLDINGS 2,125 % 14.07.26                      | 688.000   | USD     | 842.632           | 0,34                 | LLOYDS BANKING GROUP PLC 5,25 % VRN 22.08.33   | 4.500.000 | SGD     | 4.583.204         | 1,83                 |
| ENN CLEAN ENERGY INTERNATIONAL 3,375 % 12.05.26                   | 423.000   | USD     | 541.038           | 0,22                 | STANDARD CHARTERED 4,5 % VRN 14.06.33          | 5.250.000 | SGD     | 5.412.869         | 2,16                 |
| GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS 4 % VRN PERP                            | 600.000   | USD     | 797.969           | 0,32                 | STANDARD CHARTERED 6,187 % VRN 06.07.27        | 681.000   | USD     | 928.753           | 0,37                 |
| JDCOM 4,125 % 14.01.50  | 400.000   | USD     | 427.707           | 0,17                 | STANDARD CHARTERED 6,301 % VRN 09.01.29        | 600.000   | USD     | 833.033           | 0,33                 |
| MEGA ADVANCE INVESTMENTS 6,375 % 12.05.41                         | 400.000   | USD     | 597.087           | 0,24                 | VEDANTA RESOURCES 6,125 % 09.08.24             | 500.000   | USD     | 559.007           | 0,22                 |
| SANDS CHINA 3,75 % 08/08/2031                                     | 1.060.000 | USD     | 1.198.980         | 0,47                 | VEDANTA RESOURCES FINANCE 8,95 % 11.03.25      | 500.000   | USD     | 518.741           | 0,21                 |
| SF HOLDING INVESTMENT 2,875 % 20.02.30                            | 505.000   | USD     | 604.384           | 0,24                 | VEDANTA RESOURCES FINANCE 9,25 % 23.04.26      | 1.000.000 | USD     | 1.103.305         | 0,44                 |
| SINOCHEM OFFSHORE CAPITAL 1,5 % 23.09.26                          | 400.000   | USD     | 491.713           | 0,20                 |  |           |         | <b>20.545.081</b> | <b>8,19</b>          |
| TENCENT HOLDINGS 3,94 % 22.04.61                                  | 400.000   | USD     | 402.451           | 0,16                 | <b>HONGKONG</b>                                |           |         |                   |                      |
| TENCENT MUSIC ENTERTAINMENT 2,00 % 03.09.30                       | 600.000   | USD     | 665.334           | 0,27                 | AIA GROUP 2,9 % VRN PERP                       | 9.250.000 | SGD     | 8.303.962         | 3,30                 |
| WYNN MACAU 5,125 % 15.12.29                                       | 930.000   | USD     | 1.145.203         | 0,45                 | AIRPORT AUTHORITY 2,4 % VRN PERP               | 202.000   | USD     | 246.291           | 0,10                 |
| YUNDA HOLDING INVESTMENT 2,25 % 19.08.2025                        | 500.000   | USD     | 638.789           | 0,25                 | BANK OF EAST ASIA 4 % VRN 29.05.30             | 500.000   | USD     | 654.131           | 0,26                 |
| ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS 3 % 13.01.26                            | 800.000   | USD     | 1.012.265         | 0,40                 | BANK OF EAST ASIA 4,875 % VRN 22.04.32         | 500.000   | USD     | 634.452           | 0,25                 |
|   |           |         | <b>11.319.130</b> | <b>4,51</b>          | BANK OF EAST ASIA 6,625 % VRN 13.03.27         | 963.000   | USD     | 1.311.409         | 0,52                 |
| <b>FRANKREICH</b>   |           |         |                   |                      | BLOSSOM JOY 2,2 % 21.10.30                     | 891.000   | USD     | 1.023.462         | 0,41                 |
| BNP PARIBAS 4,75 % VRN 15.02.34                                   | 2.000.000 | SGD     | 2.010.507         | 0,80                 | CHAMPION PATH HOLDINGS 4,85 % 27.01.28         | 400.000   | USD     | 491.933           | 0,20                 |
| BNP PARIBAS 5,25 % VRN 12/07/2032                                 | 1.500.000 | SGD     | 1.529.101         | 0,61                 | CK HUTCHISON INTERNATIONAL 4,75 % 21.04.28     | 503.000   | USD     | 674.196           | 0,27                 |
|   |           |         |                   |                      | CLP POWER HONG KONG FINANCING 2,125 % 30.06.30 | 658.000   | USD     | 755.912           | 0,30                 |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Singapore Dollar Income Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in SGD)

| Beschreibung   | Nennwert  | Währung | Kurswert          | % des Nettovermögens | Beschreibung                                      | Nennwert  | Währung | Kurswert          | % des Nettovermögens |
|--|-----------|---------|-------------------|----------------------|---|-----------|---------|-------------------|----------------------|
| CMB INTERNATIONAL LEASING MANAGEMENT 2,75 % 12.08.30 | 200.000   | USD     | 233.942           | 0,09                 | <b>INDONESIEN</b>                                 |           |         |                   |                      |
| FORTUNE STAR 5 % 18.05.26                            | 400.000   | USD     | 465.592           | 0,19                 | ADARO INDONESIA 4,25 % 31.10.24                   | 800.000   | USD     | 1.065.409         | 0,42                 |
| FORTUNE STAR 5,05 % 27.01.27                         | 1.000.000 | USD     | 1.102.184         | 0,44                 | ALAM SUTERA REALTY 6,25 % 02.11.25                | 1.000.000 | USD     | 1.336.970         | 0,54                 |
| HONGKONG ELECTRIC FINANCE 2,25 % 09.06.30            | 516.000   | USD     | 599.832           | 0,24                 | BANK TABUNGAN NEGARA PERSERO 4,2 % 23.01.25       | 500.000   | USD     | 664.345           | 0,26                 |
| HUARONG FINANCE 3,8 % 07/11/2025                     | 3.750.000 | SGD     | 3.596.422         | 1,43                 | BUKIT MAKMUR MANDIRI UTAMA 7,75 % 10.02.26        | 800.000   | USD     | 1.076.530         | 0,43                 |
| HUTCHINSON WHAM 7,45 % 24.11.33                      | 600.000   | USD     | 949.183           | 0,38                 | INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR 4,805 % 27.04.52       | 1.200.000 | USD     | 1.330.016         | 0,53                 |
| LENOVO GROUP 6,536 % 27.07.32                        | 300.000   | USD     | 427.798           | 0,17                 | INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM 5,8 % 15.05.2050       | 400.000   | USD     | 511.739           | 0,20                 |
| MELCO RESORTS FINANCE 5,375 % 04.12.29               | 1.385.000 | USD     | 1.708.986         | 0,68                 | JAPFA COMFEED INDONESIA 5,375 % 23.03.26          | 400.000   | USD     | 498.126           | 0,20                 |
| MELCO RESORTS FINANCE 5,75 % 21.07.28                | 400.000   | USD     | 511.396           | 0,20                 | PAKUWON JATI 4,875 % 29.04.28                     | 941.000   | USD     | 1.190.450         | 0,47                 |
| PANTHER VENTURES 3,38 % PERP                         | 4.000.000 | SGD     | 2.811.569         | 1,12                 | PERTAMINA PERSERO 2,3 % 09/02/2031                | 400.000   | USD     | 449.216           | 0,18                 |
| SHANGHAI COMMERCIAL BANK 6,375 % VRN 28.02.33        | 400.000   | USD     | 546.273           | 0,22                 | PERTAMINA PERSERO 3,1 % 21.01.30                  | 448.000   | USD     | 542.106           | 0,22                 |
| SINOCHEM OVERSEAS 6,3 % 12/11/2040                   | 400.000   | USD     | 591.003           | 0,24                 | PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA 4,375 % 05.02.50        | 400.000   | USD     | 431.840           | 0,17                 |
| STUDIO CITY FINANCE 5 % 15.01.29                     | 800.000   | USD     | 951.678           | 0,38                 | PERUSAHAAN PERSEROAN PERSERO 3 % 30.06.30         | 450.000   | USD     | 530.607           | 0,21                 |
| STUDIO CITY FINANCE 6,5 % 15.01.28                   | 735.000   | USD     | 945.946           | 0,38                 | STAR ENERGY GEOTHERMAL DARAJAT 4,85 % 14.10.2038  | 800.000   | USD     | 1.001.797         | 0,40                 |
| XIAOMI BEST TIME INTERNATIONAL 4,1 % 14.07.51        | 800.000   | USD     | 777.042           | 0,31                 | STAR ENGY GEOTHERMAL WAYANG WINDU 6,75 % 24.04.33 | 800.000   | USD     | 882.171           | 0,35                 |
|  |           |         | <b>30.314.594</b> | <b>12,08</b>         |   |           |         | <b>11.511.322</b> | <b>4,58</b>          |
| <b>INDIEN</b>  |           |         |                   |                      | <b>JAPAN</b>                                      |           |         |                   |                      |
| DELHI INTERNATIONAL AIRPORT 6,125 % 31.10.2026       | 400.000   | USD     | 535.557           | 0,21                 | ASAHI MUTUAL LIFE INSURANCE 4,1 % VRN PERP        | 1.000.000 | USD     | 1.189.988         | 0,48                 |
| DELHI INTERNATIONAL AIRPORT 6,45 % 04.06.29          | 600.000   | USD     | 800.099           | 0,32                 | FUKOKU MUTUAL LIFE INSURANCE 6,8 % VRN PERP       | 800.000   | USD     | 1.138.828         | 0,45                 |
| GMR HYDERABAD INTERNATIONAL 4,75 % 02.02.26          | 600.000   | USD     | 786.231           | 0,31                 | MEIJI YASUDA LIFE INSURANCE 5,1 % VRN 26.04.48    | 800.000   | USD     | 1.059.771         | 0,42                 |
| GMR HYDERABAD INTERNATIONAL AIRPORT 4,25 % 27.10.27  | 800.000   | USD     | 1.002.460         | 0,41                 | MIZUHO FINANCIAL 5,579 % 26.05.35                 | 309.000   | USD     | 422.774           | 0,17                 |
| HPCL MITTAL ENERGY 5,25 % 28.04.27                   | 400.000   | USD     | 521.215           | 0,21                 | NIPPON LIFE INSURANCE 6,25 % VRN 13.09.53         | 800.000   | USD     | 1.128.296         | 0,45                 |
| HPCLMITTAL ENERGY 5,45 % 22.10.26                    | 400.000   | USD     | 526.062           | 0,21                 | SUMITOMO LIFE INSURANCE 5,875 % VRN PERP          | 864.000   | USD     | 1.163.053         | 0,46                 |
| INDIABULLS HOUSING FINANCE 9,7 % 03.07.27            | 717.000   | USD     | 968.022           | 0,39                 | SUMITOMO MITSUI FINANCIAL 6,184 % 13.07.43        | 844.000   | USD     | 1.266.747         | 0,51                 |
| JSW INFRASTRUCTURE 4,95 % 21.01.29                   | 400.000   | USD     | 507.827           | 0,20                 |   |           |         | <b>7.369.457</b>  | <b>2,94</b>          |
| RELIANCE INDUSTRIES 3,75 % 12.01.62                  | 400.000   | USD     | 385.655           | 0,15                 | <b>MACAU</b>                                      |           |         |                   |                      |
| RENEW WIND ENERGY 4,5 % 14.07.28                     | 450.000   | USD     | 555.841           | 0,22                 | MGM CHINA HOLDINGS 4,75 % 01.02.27                | 788.000   | USD     | 1.014.621         | 0,41                 |
|  |           |         | <b>6.588.969</b>  | <b>2,63</b>          | MGM CHINA HOLDINGS 5,875 % 15.05.26               | 300.000   | USD     | 400.856           | 0,16                 |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Singapore Dollar Income Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in SGD)

| Beschreibung  | Nennwert  | Währung | Kurswert         | % des Nettovermögens | Beschreibung  | Nennwert  | Währung | Kurswert  | % des Nettovermögens |
|---|-----------|---------|------------------|----------------------|---|-----------|---------|-----------|----------------------|
| WYNN MACAU 5,625 %<br>26.08.28                        | 750.000   | USD     | 960.168          | 0,38                 | CHANGI AIRPORT GROUP<br>SINGAPORE 1,88 % 12.05.2031 | 5.500.000 | SGD     | 4.884.083 | 1,95                 |
|   |           |         | <b>2.375.645</b> | <b>0,95</b>          | CMT 2,1 % 08.03.28                                  | 2.500.000 | SGD     | 2.362.142 | 0,94                 |
| <b>MALAYSIA</b>                                       |           |         |                  |                      | CMT 2,15 % 07.12.32                                 | 3.250.000 | SGD     | 2.844.176 | 1,13                 |
| KHAZANAH CAPITAL 4,876 %<br>01/06/2033                | 392.000   | USD     | 522.882          | 0,21                 | CMT MTN 3,938 % 19.06.2030                          | 1.500.000 | SGD     | 1.523.539 | 0,61                 |
|   |           |         | <b>522.882</b>   | <b>0,21</b>          | CONTINUUM ENERGY AURA<br>9,5 % 24.02.27             | 800.000   | USD     | 1.123.296 | 0,45                 |
| <b>MAURITIUS</b>                                      |           |         |                  |                      | HOUSING DEVELOPMENT<br>BOARD 1,265 % 24.06.30       | 3.750.000 | SGD     | 3.324.444 | 1,32                 |
| CLEAN RENEWABLE POWER<br>4,25 % 25.03.27              | 599.000   | USD     | 655.596          | 0,26                 | HOUSING DEVELOPMENT<br>BOARD 1,3 % 03.12.35         | 1.000.000 | SGD     | 806.454   | 0,32                 |
| DIAMOND 7,95 % 28.07.2026                             | 800.000   | USD     | 1.099.122        | 0,44                 | HOUSING DEVELOPMENT<br>BOARD 1,73 % 19.05.31        | 3.500.000 | SGD     | 3.161.360 | 1,26                 |
| GREENKO SOLAR MAURITIUS<br>5,55 % 29.01.25            | 830.000   | USD     | 1.108.338        | 0,44                 | HOUSING DEVELOPMENT<br>BOARD 1,865 % 21.07.33       | 250.000   | SGD     | 221.565   | 0,09                 |
| GREENKO SOLAR MAURITIUS<br>5,95 % 29.07.26            | 320.000   | USD     | 421.501          | 0,17                 | HOUSING DEVELOPMENT<br>BOARD 2,315 % 18.09.34       | 4.750.000 | SGD     | 4.332.233 | 1,73                 |
| INDIA AIRPORT INFRA<br>6,25 % 25.10.25                | 980.000   | USD     | 1.324.077        | 0,53                 | HPHT FINANCE 1,5 %<br>17.09.26                      | 587.000   | USD     | 722.673   | 0,29                 |
| INDIA GREEN POWER<br>HOLDINGS 4 % 22.02.27            | 340.000   | USD     | 398.613          | 0,16                 | INDIKA ENERGY CAPITAL<br>8,25 % 22.10.25            | 821.000   | USD     | 1.117.332 | 0,45                 |
|   |           |         | <b>5.007.247</b> | <b>2,00</b>          | LAND TRANSPORT<br>AUTHORITY 3,38 % 30.01.59         | 250.000   | SGD     | 246.262   | 0,10                 |
| <b>MONGOLEI</b>                                       |           |         |                  |                      | LLPL CAPITAL 6,875 %<br>04/02/2039                  | 800.000   | USD     | 832.894   | 0,33                 |
| MONGOLIA (GOVT) 7,875 %<br>05/06/2029                 | 313.000   | USD     | 437.271          | 0,17                 | MEDCO BELL 6,375 %<br>30.01.27                      | 550.000   | USD     | 724.210   | 0,29                 |
| MONGOLIA (GOVT) 8,65 %<br>19.01.28                    | 410.000   | USD     | 584.420          | 0,23                 | MEDCO LAUREL TREE 6,95 %<br>12/11/2028              | 560.000   | USD     | 734.712   | 0,29                 |
| MONGOLIAN MINING CORPENRGY<br>12,5 % 13.09.26         | 800.000   | USD     | 1.165.757        | 0,47                 | MEDCO MAPLE TREE 8,96 %<br>27.04.29                 | 800.000   | USD     | 1.124.947 | 0,45                 |
|   |           |         | <b>2.187.448</b> | <b>0,87</b>          | MPACT TREASURY 3,9 %<br>07/03/2034                  | 3.000.000 | SGD     | 3.044.644 | 1,21                 |
| <b>NIEDERLANDE</b>                                    |           |         |                  |                      | MPACT TREASURY 4,25 %<br>29.03.30                   | 2.250.000 | SGD     | 2.314.893 | 0,92                 |
| MINEJESA CAPITAL 5,625 %<br>10/08/2037                | 800.000   | USD     | 979.516          | 0,39                 | NATIONAL ENVIRONMENT<br>AGENCY 2,5 % 15.09.51       | 5.250.000 | SGD     | 4.325.213 | 1,72                 |
|   |           |         | <b>979.516</b>   | <b>0,39</b>          | OVERSEACHINESE BANKING<br>3 % VRN PERP              | 2.750.000 | SGD     | 2.607.915 | 1,04                 |
| <b>PAKISTAN</b>                                       |           |         |                  |                      | OVERSEACHINESE BANKING<br>4,05 % VRN PERP           | 2.000.000 | SGD     | 2.019.758 | 0,80                 |
| PAKISTAN (GOVT) 6 %<br>08/04/2026                     | 800.000   | USD     | 968.430          | 0,39                 | OVERSEAS CHINESE BANKING<br>4,602 % VRN 15.06.32    | 910.000   | USD     | 1.203.172 | 0,48                 |
|   |           |         | <b>968.430</b>   | <b>0,39</b>          | PUBLIC UTILITIES BOARD<br>3,433 % 30.08.52          | 500.000   | SGD     | 503.232   | 0,20                 |
| <b>PHILIPPINEN</b>                                    |           |         |                  |                      | SEMBCORP FINANCIAL<br>SERVICES 2,45 % 09.06.31      | 1.500.000 | SGD     | 1.364.628 | 0,54                 |
| METROPOLITAN BANK<br>5,375 % 06.03.29                 | 463.000   | USD     | 626.393          | 0,25                 | SEMBCORP FINANCIAL<br>SERVICES 4,6 % 15.03.30       | 4.000.000 | SGD     | 4.146.444 | 1,65                 |
| METROPOLITAN BANK 5,5 %<br>06/03/2034                 | 404.000   | USD     | 546.647          | 0,22                 | SINGAPORE (GOVT) 3 %<br>01/08/2072                  | 5.000.000 | SGD     | 5.003.038 | 1,99                 |
|   |           |         | <b>1.173.040</b> | <b>0,47</b>          | SINGTEL GROUP TREASURY<br>3,3 % VRN PERP            | 6.250.000 | SGD     | 5.889.035 | 2,35                 |
| <b>SINGAPUR</b>                                       |           |         |                  |                      |   |           |         |           |                      |
| ABJA INVESTMENT 5,95 %<br>31.07.24                    | 270.000   | USD     | 364.039          | 0,15                 |   |           |         |           |                      |
| ASCENDAS REAL ESTATE<br>INVESTMENT 2,65 % 26.08.30    | 2.500.000 | SGD     | 2.359.793        | 0,94                 |   |           |         |           |                      |
| ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT<br>3,468 % 19.04.29   | 1.750.000 | SGD     | 1.734.879        | 0,69                 |   |           |         |           |                      |
| ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT<br>TRUST 3 % VRN PERP | 2.000.000 | SGD     | 1.945.999        | 0,78                 |   |           |         |           |                      |
| CAPITALAND TREASURY<br>2,9 % 21.09.32                 | 1.500.000 | SGD     | 1.410.256        | 0,56                 |   |           |         |           |                      |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Singapore Dollar Income Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in SGD)

| Beschreibung                            | Nennwert  | Währung | Kurswert          | % des Nettovermögens | Beschreibung   | Nennwert  | Währung | Kurswert           | % des Nettovermögens |
|---|-----------|---------|-------------------|----------------------|--|-----------|---------|--------------------|----------------------|
| TEMASEK FINANCIAL 4 %<br>07/12/2029     | 1.000.000 | SGD     | 1.029.989         | 0,41                 | <b>THAILAND</b>  |           |         |                    |                      |
| TML HOLDINGS 4,35 %<br>09/06/2026       | 428.000   | USD     | 555.698           | 0,22                 | BANGKOK BANK 3,466 % VRN<br>23.09.36   | 1.600.000 | USD     | 1.824.441          | 0,73                 |
| UNITED OVERSEAS BANK<br>2,55 % VRN PERP | 1.500.000 | SGD     | 1.407.425         | 0,56                 | KASIKORNBANK 3,343 % VRN<br>02/10/2031   | 800.000   | USD     | 1.004.701          | 0,40                 |
| UNITED OVERSEAS BANK<br>5,25 % VRN PERP | 750.000   | SGD     | 785.116           | 0,31                 | KRUNG THAI BANK 4,4 %<br>VRN PERP  | 500.000   | USD     | 641.673            | 0,26                 |
|   |           |         | <b>74.101.488</b> | <b>29,52</b>         | MINOR INTERNATIONAL<br>2,7 % VRN PERP  | 800.000   | USD     | 1.013.688          | 0,40                 |
| <b>SÜDKOREA</b>                         |           |         |                   |                      | THAI OIL TREASURY CENTER<br>3,75 % 18.06.50                                      | 400.000   | USD     | 386.765            | 0,15                 |
| GS CALTEX 5,375 %<br>07/08/2028         | 690.000   | USD     | 935.002           | 0,37                 |  |           |         | <b>4.871.268</b>   | <b>1,94</b>          |
| KB CAPITAL 1,5 %<br>28.10.25            | 800.000   | USD     | 1.006.235         | 0,40                 | <b>USA</b>   |           |         |                    |                      |
| KODIT GLOBAL 4,954 %<br>25.05.26        | 570.000   | USD     | 762.734           | 0,30                 | BOC AVIATION 4,875 %<br>03/05/2033   | 321.000   | USD     | 425.533            | 0,17                 |
| KOOKMIN BANK 2,5 %<br>04/11/2030        | 692.000   | USD     | 778.164           | 0,31                 | PERIAMA HOLDINGS 5,95 %<br>19.04.26  | 600.000   | USD     | 800.811            | 0,32                 |
| LG ENERGY SOLUTION<br>5,75 % 25.09.28   | 511.000   | USD     | 700.464           | 0,28                 | RESORTS WORLD LAS VEGAS<br>4,625 % 06.04.31                                      | 600.000   | USD     | 706.337            | 0,28                 |
| POSCO 4,875 % 23.01.27                  | 391.000   | USD     | 521.394           | 0,21                 | RESORTS WORLD LAS VEGAS<br>8,45 % 27.07.30                                       | 800.000   | USD     | 1.165.678          | 0,47                 |
| POSCO 5,875 % 17.01.33                  | 200.000   | USD     | 280.372           | 0,11                 | SASOL FINANCING 5,5 %<br>18.03.31  | 1.000.000 | USD     | 1.140.311          | 0,45                 |
| SHINHAN BANK 4 %<br>23.04.29            | 1.000.000 | USD     | 1.260.145         | 0,50                 |  |           |         | <b>4.238.670</b>   | <b>1,69</b>          |
| SHINHAN CARD 5,5 %<br>12/03/2029        | 435.000   | USD     | 591.219           | 0,24                 | <b>SUMME ANLEIHEN</b>  |           |         | <b>227.962.799</b> | <b>90,84</b>         |
| SK BROADBAND 4,875 %<br>28.06.28        | 228.000   | USD     | 304.929           | 0,12                 | <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN<br/>BÖRSE NOTIERTEN WERTPAPIERE</b>              |           |         | <b>227.962.799</b> | <b>90,84</b>         |
| SK HYNIX 5,5 % 16.01.2027               | 400.000   | USD     | 540.202           | 0,22                 | <b>WERTPAPIERE</b>   |           |         |                    |                      |
| SK HYNIX 5,5 % 16.01.29                 | 400.000   | USD     | 539.189           | 0,21                 | <b>AN EINEM ANDEREM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE, ÜBERTRAGBARE<br/>WERTPAPIERE</b> |           |         |                    |                      |
| SK HYNIX 6,5 % 17.01.33                 | 800.000   | USD     | 1.154.018         | 0,46                 |  |           |         |                    |                      |
|   |           |         | <b>9.374.067</b>  | <b>3,73</b>          | <b>ANLEIHEN</b>  |           |         |                    |                      |
| <b>SRI LANKA</b>                        |           |         |                   |                      | <b>AUSTRALIEN</b>  |           |         |                    |                      |
| SRI LANKA (GOVT) 6,125 %<br>03/06/2025  | 800.000   | USD     | 650.195           | 0,25                 | CIMIC FINANCE 7 %<br>25.03.34  | 351.000   | USD     | 486.549            | 0,19                 |
| SRI LANKA (GOVT) 6,2 %<br>11/05/2027    | 800.000   | USD     | 639.425           | 0,25                 |  |           |         | <b>486.549</b>     | <b>0,19</b>          |
| SRI LANKA (GOVT) 6,35 %<br>28.06.24     | 200.000   | USD     | 159.912           | 0,06                 | <b>CHINA</b>   |           |         |                    |                      |
| SRI LANKA (GOVT) 6,75 %<br>18.04.28     | 800.000   | USD     | 640.364           | 0,26                 | ALIBABA GROUP HOLDING<br>3,25 % 09.02.61   | 400.000   | USD     | 345.952            | 0,14                 |
| SRI LANKA (GOVT) 6,825 %<br>18.07.26    | 800.000   | USD     | 647.786           | 0,26                 | MEITUAN DIANPING 3,05 %<br>28.10.30  | 400.000   | USD     | 463.341            | 0,18                 |
| SRI LANKA (GOVT) 6,85 %<br>03/11/2025   | 800.000   | USD     | 649.234           | 0,26                 |  |           |         | <b>809.293</b>     | <b>0,32</b>          |
| SRI LANKA (GOVT) 7,55 %<br>28.03.30     | 400.000   | USD     | 318.461           | 0,13                 | <b>HONGKONG</b>  |           |         |                    |                      |
| SRI LANKA (GOVT) 7,85 %<br>14.03.29     | 400.000   | USD     | 319.273           | 0,13                 | AIA GROUP 5,375 %<br>05/04/2034  | 846.000   | USD     | 1.143.249          | 0,46                 |
|   |           |         | <b>4.024.650</b>  | <b>1,60</b>          | STUDIO CITY 7 % 15.02.2027   | 505.000   | USD     | 682.910            | 0,27                 |
| <b>SCHWEIZ</b>                          |           |         |                   |                      |  |           |         | <b>1.826.159</b>   | <b>0,73</b>          |
| UBS GROUP 5,75 % VRN PERP               | 3.250.000 | SGD     | 3.277.068         | 1,31                 | <b>INDIEN</b>  |           |         |                    |                      |
|   |           |         | <b>3.277.068</b>  | <b>1,31</b>          | ADANI GREEN ENERGY 6,7 %<br>12/03/2042   | 792.000   | USD     | 1.036.232          | 0,42                 |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Singapore Dollar Income Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in SGD)

| Beschreibung                         | Nennwert  | Währung | Kurswert         | % des Nettovermögens | Beschreibung                                       | Nennwert | Währung | Kurswert           | % des Nettovermögens |
|--------------------------------------|-----------|---------|------------------|----------------------|--|----------|---------|--------------------|----------------------|
| <b>IRB INFRASTRUCTURE DEVELOPERS</b> |           |         |                  |                      | <b>USA</b>   |          |         |                    |                      |
| 7,11 % 11.03.32                      | 678.000   | USD     | 929.175          | 0,37                 | HYUNDAI CAPITAL AMERICA                            |          |         |                    |                      |
| JSW HYDRO ENERGY 4,125 %             |           |         |                  |                      | 2,1 % 15.09.28                                     | 673.000  | USD     | 796.933            | 0,32                 |
| 18.05.31                             | 775.000   | USD     | 747.175          | 0,30                 |  |          |         | <b>796.933</b>     | <b>0,32</b>          |
| RELIANCE INDUSTRIES                  |           |         |                  |                      | <b>SUMME ANLEIHEN</b>                              |          |         | <b>20.279.509</b>  | <b>8,08</b>          |
| 2,875 % 12.01.32                     | 250.000   | USD     | 287.093          | 0,11                 | <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN</b>                |          |         | <b>20.279.509</b>  | <b>8,08</b>          |
| SHRIRAM FINANCE 6,625 %              |           |         |                  |                      | <b>MARKT GEHANDELTEN ÜBERTRAGBAREN WERTPAPIERE</b> |          |         |                    |                      |
| 22.04.27                             | 707.000   | USD     | 958.494          | 0,38                 |  |          |         |                    |                      |
|                                      |           |         | <b>3.958.169</b> | <b>1,58</b>          | <b>SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>           |          |         |                    |                      |
| <b>INDONESIEN</b>                    |           |         |                  |                      | <b>ANLEIHEN</b>                                    |          |         |                    |                      |
| FREEPORT INDONESIA                   |           |         |                  |                      | <b>INDONESIEN</b>                                  |          |         |                    |                      |
| 5,315 % 14.04.32                     | 533.000   | USD     | 704.154          | 0,28                 | KAWASAN INDUSTRI                                   |          |         |                    |                      |
| FREEPORT INDONESIA 6,2 %             |           |         |                  |                      | JABABEKA TBK 7 % 15.12.2027                        | 800.000  | USD     | 990.715            | 0,39                 |
| 14.04.52                             | 800.000   | USD     | 1.075.695        | 0,43                 |  |          |         | <b>990.715</b>     | <b>0,39</b>          |
|                                      |           |         | <b>1.779.849</b> | <b>0,71</b>          | <b>NIEDERLANDE</b>                                 |          |         |                    |                      |
| <b>IRLAND</b>                        |           |         |                  |                      | IHS NETHERLANDS HOLDCO                             |          |         |                    |                      |
| SMBC AVIATION CAPITAL                |           |         |                  |                      | 8 % 18.09.27                                       | 400.000  | USD     | 517.040            | 0,21                 |
| FINANCE 5,7 % 25.07.33               | 1.047.000 | USD     | 1.427.271        | 0,57                 |  |          |         | <b>517.040</b>     | <b>0,21</b>          |
|                                      |           |         | <b>1.427.271</b> | <b>0,57</b>          | <b>SUMME ANLEIHEN</b>                              |          |         | <b>1.507.755</b>   | <b>0,60</b>          |
| <b>MACAU</b>                         |           |         |                  |                      | <b>SUMME SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>     |          |         | <b>1.507.755</b>   | <b>0,60</b>          |
| MGM CHINA HOLDINGS                   |           |         |                  |                      | <b>SUMME WERTPAPIERANLAGEN</b>                     |          |         | <b>249.750.063</b> | <b>99,52</b>         |
| 5,25 % 18.06.25                      | 200.000   | USD     | 266.261          | 0,11                 | <b>SONSTIGES NETTOVERMÖGEN</b>                     |          |         | <b>1.204.885</b>   | <b>0,48</b>          |
| SANDS CHINA 5,4 %                    |           |         |                  |                      | <b>GESAMTNETTOVERMÖGEN</b>                         |          |         | <b>250.954.948</b> | <b>100,00</b>        |
| 08/08/2028                           | 500.000   | USD     | 662.233          | 0,26                 |  |          |         |                    |                      |
|                                      |           |         | <b>928.494</b>   | <b>0,37</b>          |  |          |         |                    |                      |
| <b>MAURITIUS</b>                     |           |         |                  |                      |  |          |         |                    |                      |
| CA MAGNUM HOLDINGS                   |           |         |                  |                      |  |          |         |                    |                      |
| 5,375 % 31.10.26                     | 728.000   | USD     | 944.290          | 0,38                 |  |          |         |                    |                      |
| INDIA CLEAN ENERGY                   |           |         |                  |                      |  |          |         |                    |                      |
| HOLDINGS 4,5 % 18.04.27              | 800.000   | USD     | 991.043          | 0,39                 |  |          |         |                    |                      |
| NETWORK 5,65 % VRN PERP              | 200.000   | USD     | 268.036          | 0,11                 |  |          |         |                    |                      |
|                                      |           |         | <b>2.203.369</b> | <b>0,88</b>          |  |          |         |                    |                      |
| <b>NIEDERLANDE</b>                   |           |         |                  |                      |  |          |         |                    |                      |
| LISTRINDO CAPITAL 4,95 %             |           |         |                  |                      |  |          |         |                    |                      |
| 14.09.26                             | 800.000   | USD     | 1.045.685        | 0,42                 |  |          |         |                    |                      |
| PROSUS 4,987 % 19.01.52              | 1.200.000 | USD     | 1.195.338        | 0,47                 |  |          |         |                    |                      |
|                                      |           |         | <b>2.241.023</b> | <b>0,89</b>          |  |          |         |                    |                      |
| <b>PAKISTAN</b>                      |           |         |                  |                      |  |          |         |                    |                      |
| PAKISTAN (GOVT) 6,875 %              |           |         |                  |                      |  |          |         |                    |                      |
| 05/12/2027                           | 800.000   | USD     | 925.448          | 0,36                 |  |          |         |                    |                      |
| PAKISTAN (GOVT) 7,375 %              |           |         |                  |                      |  |          |         |                    |                      |
| 08/04/2031                           | 800.000   | USD     | 853.042          | 0,34                 |  |          |         |                    |                      |
| PAKISTAN (GOVT) 8,875 %              |           |         |                  |                      |  |          |         |                    |                      |
| 08/04/2051                           | 800.000   | USD     | 818.370          | 0,33                 |  |          |         |                    |                      |
|                                      |           |         | <b>2.596.860</b> | <b>1,03</b>          |  |          |         |                    |                      |
| <b>SINGAPUR</b>                      |           |         |                  |                      |  |          |         |                    |                      |
| CONTINUUM ENERGY                     |           |         |                  |                      |  |          |         |                    |                      |
| LEVANTER 4,5 % 09.02.2027            | 200.000   | USD     | 222.152          | 0,09                 |  |          |         |                    |                      |
|                                      |           |         | <b>222.152</b>   | <b>0,09</b>          |  |          |         |                    |                      |
| <b>SÜDKOREA</b>                      |           |         |                  |                      |  |          |         |                    |                      |
| HANWHA LIFE INSURANCE                |           |         |                  |                      |  |          |         |                    |                      |
| 3,379 % VRN 04.02.32                 | 800.000   | USD     | 1.003.388        | 0,40                 |  |          |         |                    |                      |
|                                      |           |         | <b>1.003.388</b> | <b>0,40</b>          |  |          |         |                    |                      |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Ultra Short Duration Bond

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung                   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|--------------------------------|--------------------------|---------|----------|------------------------------|
| <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>  |                          |         |                   |                              | <b>LLOYDS BANKING GROUP</b>    |                          |         |          |                              |
| <b>AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |                          |         |                   |                              | FRN 07.08.27                   |                          |         |          |                              |
| <b>ANLEIHEN</b>   |                          |         |                   |                              | 6.000.000 USD 6.071.590 0,56   |                          |         |          |                              |
| <b>AUSTRALIEN</b>   |                          |         |                   |                              | NATWEST MARKETS FRN            |                          |         |          |                              |
| WESTPAC BANKING 5,512 %   |                          |         |                   |                              | 22.03.25                       |                          |         |          |                              |
| 17.11.25  | 4.000.000                | USD     | 4.032.453         | 0,37                         | 5.000.000 USD 5.042.228 0,47   |                          |         |          |                              |
| WESTPAC BANKING FRN   |                          |         |                   |                              | RECKITT BENCKISER TREASURY     |                          |         |          |                              |
| 17.11.25  | 4.000.000                | USD     | 4.018.161         | 0,37                         | SERVICES 2,75 % 26.06.24       |                          |         |          |                              |
|   |                          |         | <b>8.050.614</b>  | <b>0,74</b>                  | 11.950.000 USD 11.868.492 1,10 |                          |         |          |                              |
| <b>KANADA</b>   |                          |         |                   |                              | STANDARD CHARTERED             |                          |         |          |                              |
| BANK OF MONTREAL 5,92 %   |                          |         |                   |                              | 3,971 % VRN 30.03.26           |                          |         |          |                              |
| 25.09.25  | 2.000.000                | USD     | 2.021.428         | 0,19                         | 1.000.000 USD 982.216 0,09     |                          |         |          |                              |
| BANK OF NOVA SCOTIA   |                          |         |                   |                              | STANDARD CHARTERED FRN         |                          |         |          |                              |
| 5,35 % 07.12.26   | 2.000.000                | USD     | 2.011.934         | 0,19                         | 23.11.25                       |                          |         |          |                              |
| CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMM-<br>ERCE FRN 18.10.2024            | 2.000.000                | USD     | 2.001.950         | 0,18                         | 2.000.000 USD 2.000.509 0,18   |                          |         |          |                              |
| NUTRIEN 5,9 % 07.11.24  | 5.000.000                | USD     | 5.008.082         | 0,46                         | STANDARD CHARTERED FRN         |                          |         |          |                              |
| NUTRIEN 5,95 % 07.11.2025   | 2.000.000                | USD     | 2.018.616         | 0,19                         | 30.03.26                       |                          |         |          |                              |
| ROYAL BANK OF CANADA  |                          |         |                   |                              | 4.605.000 USD 4.650.256 0,43   |                          |         |          |                              |
| 4,95 % 25.04.25   | 2.290.000                | USD     | 2.282.757         | 0,21                         | VODAFONE GROUP 4,125 %         |                          |         |          |                              |
| ROYAL BANK OF CANADA  |                          |         |                   |                              | 30.05.25                       |                          |         |          |                              |
| 5,66 % 25.10.24   | 1.000.000                | USD     | 1.000.985         | 0,09                         | 9.500.000 USD 9.361.148 0,86   |                          |         |          |                              |
| TORONTODOMINION BANK  |                          |         |                   |                              | <b>49.528.954 4,58</b>         |                          |         |          |                              |
| FRN 17.07.26  | 4.000.000                | USD     | 4.040.479         | 0,37                         | <b>IRLAND</b>                  |                          |         |          |                              |
|   |                          |         | <b>20.386.231</b> | <b>1,88</b>                  | APTIV 2,396 % 18.02.25         |                          |         |          |                              |
| <b>FRANKREICH</b>   |                          |         |                   |                              | 500.000 USD 485.899 0,04       |                          |         |          |                              |
| LVMH MOET HENNESSY  |                          |         |                   |                              | BANK OF IRELAND 6,253 %        |                          |         |          |                              |
| LOUIS VUITTO 3,375 %  |                          |         |                   |                              | VRN 16.09.26                   |                          |         |          |                              |
| 21.10.25  | 1.000.000                | EUR     | 1.081.001         | 0,10                         | 2.000.000 USD 2.013.296 0,19   |                          |         |          |                              |
|   |                          |         | <b>1.081.001</b>  | <b>0,10</b>                  | JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL |                          |         |          |                              |
| <b>DEUTSCHLAND</b>  |                          |         |                   |                              | 3,625 % 02.07.24               |                          |         |          |                              |
| DEUTSCHE BANK 2,625 %   |                          |         |                   |                              | 3.000.000 USD 2.983.881 0,28   |                          |         |          |                              |
| 16.12.24  | 1.000.000                | GBP     | 1.237.326         | 0,11                         | <b>5.483.076 0,51</b>          |                          |         |          |                              |
|   |                          |         | <b>1.237.326</b>  | <b>0,11</b>                  | <b>JAPAN</b>                   |                          |         |          |                              |
| <b>GROSSBRITANNIEN</b>  |                          |         |                   |                              | MITSUBISHI UFJ FINANCIAL       |                          |         |          |                              |
| BARCLAYS FRN 12.03.2028   | 3.000.000                | USD     | 3.018.780         | 0,28                         | GROUP FRN 12.09.2025           |                          |         |          |                              |
| BARCLAYS FRN 13.09.27   | 3.000.000                | USD     | 3.046.799         | 0,28                         | 4.000.000 USD 4.017.765 0,37   |                          |         |          |                              |
| BP CAPITAL MARKETS PLC  |                          |         |                   |                              | MITSUBISHI UFJ                 |                          |         |          |                              |
| 1,876 % 07.04.24  | 1.000.000                | EUR     | 1.079.747         | 0,10                         | FINANCIAL FRN 20.02.26         |                          |         |          |                              |
| GLAXOSMITHKLINE 1,375 %   |                          |         |                   |                              | 1.000.000 USD 1.002.819 0,09   |                          |         |          |                              |
| 02/12/2024  | 2.000.000                | EUR     | 2.126.622         | 0,20                         | MITSUBISHI UFJ FINANCIAL       |                          |         |          |                              |
| LLOYDS BANKING GROUP  |                          |         |                   |                              | GROUP FRN 17.04.26             |                          |         |          |                              |
| 2,25 % 16.10.24   | 226.000                  | GBP     | 280.567           | 0,03                         | 6.000.000 USD 6.047.481 0,56   |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                   |                              | NTT FINANCE 4,239 %            |                          |         |          |                              |
| <b>NIEDERLANDE</b>  |                          |         |                   |                              | 25.07.25                       |                          |         |          |                              |
| ABN AMRO BANK FRN   |                          |         |                   |                              | 1.000.000 USD 986.889 0,09     |                          |         |          |                              |
| 18.09.27  | 1.000.000                | USD     | 1.013.209         | 0,09                         | SUMITOMO MITSUI FINANCIAL      |                          |         |          |                              |
| COOPERATIEVE RABOBANK   |                          |         |                   |                              | GROUP FRN 13.01.26             |                          |         |          |                              |
| FRN 05.03.27  | 4.000.000                | USD     | 4.005.164         | 0,37                         | 1.000.000 USD 1.014.249 0,09   |                          |         |          |                              |
| ING GROEP 3,55 %  |                          |         |                   |                              | SUMITOMO MITSUI TRUST          |                          |         |          |                              |
| 09/04/2024  | 3.500.000                | USD     | 3.498.884         | 0,32                         | BANK FRN 09.03.2026            |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                   |                              | 5.000.000 USD 5.039.995 0,47   |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                   |                              | SUMITOMO MITSUI TRUST          |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                   |                              | BANK FRN 14.09.26              |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                   |                              | 2.000.000 USD 2.022.817 0,19   |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                   |                              | SUMITOMO MITSUI FINANCIAL      |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                   |                              | GROUP FRN 13.07.2026           |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                   |                              | 4.000.000 USD 4.050.224 0,37   |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                   |                              | <b>24.182.239 2,23</b>         |                          |         |          |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Ultra Short Duration Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung                  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung                | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert   | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|-------------------------------|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|-----------------------------|--------------------------|---------|------------|------------------------------|
| ING GROEP FRN 28.03.2026      | 2.000.000                | USD     | 2.021.278         | 0,19                         | BANK OF AMERICA 4,2 %       |                          |         |            |                              |
| MONDELEZ INTERNATIONAL        |                          |         |                   |                              | 26.08.24                    | 3.000.000                | USD     | 2.981.860  | 0,28                         |
| HOLDINGS 4,25 % 15.09.25      | 1.500.000                | USD     | 1.477.480         | 0,14                         | BANK OF AMERICA 5,65 %      |                          |         |            |                              |
|                               |                          |         | <b>12.016.015</b> | <b>1,11</b>                  | 18.08.25                    | 2.000.000                | USD     | 2.013.232  | 0,19                         |
| <b>SINGAPUR</b>               |                          |         |                   |                              | BANK OF AMERICA CORP        |                          |         |            |                              |
| DBS GROUP HOLDINGS            |                          |         |                   |                              | FRN 05.02.26                | 3.909.000                | USD     | 3.932.297  | 0,36                         |
| 5,479 % 12.09.25              | 2.000.000                | USD     | 2.009.123         | 0,19                         | BANK OF AMERICA CORP        |                          |         |            |                              |
| DBS GROUP HOLDINGS FRN        |                          |         |                   |                              | FRN 15.09.26                | 1.239.000                | USD     | 1.245.635  | 0,12                         |
| 22.11.24                      | 7.595.000                | USD     | 7.586.118         | 0,70                         | BAXALTA 4 % 23.06.2025      | 3.000.000                | USD     | 2.952.597  | 0,27                         |
| DBS GROUP HOLDINGS FRN        |                          |         |                   |                              | CATERPILLAR FINANCIAL       |                          |         |            |                              |
| 12/09/2025                    | 2.000.000                | USD     | 2.004.873         | 0,19                         | SERVICES FRN 27.02.2026     | 10.000.000               | USD     | 10.015.217 | 0,93                         |
| PFIZER INVESTMENT ENTERPRISES |                          |         |                   |                              | CELANESE US HOLDINGS        |                          |         |            |                              |
| 4,65 % 19.05.25               | 2.000.000                | USD     | 1.988.508         | 0,18                         | 5,9 % 05.07.24              | 5.000.000                | USD     | 4.998.218  | 0,46                         |
|                               |                          |         | <b>13.588.622</b> | <b>1,26</b>                  | CELANESE US HOLDINGS        |                          |         |            |                              |
| <b>SPANIEN</b>                |                          |         |                   |                              | 6,05 % 15.03.25             | 1.000.000                | USD     | 1.002.365  | 0,09                         |
| BANCO SANTANDER 2,706 %       |                          |         |                   |                              | CITIGROUP 2,375 %           |                          |         |            |                              |
| 27.06.24                      | 400.000                  | USD     | 397.300           | 0,04                         | 22.05.24                    | 1.000.000                | EUR     | 1.077.828  | 0,10                         |
| BANCO SANTANDER 3,892 %       |                          |         |                   |                              | CITIGROUP FRN 24.05.2025    | 3.000.000                | USD     | 3.002.895  | 0,28                         |
| 24.05.24                      | 4.200.000                | USD     | 4.189.920         | 0,38                         | CITIGROUP FRN 01.07.26      | 500.000                  | USD     | 508.375    | 0,05                         |
| BANCO SANTANDER FRN           |                          |         |                   |                              | CNH INDUSTRIAL CAPITAL      |                          |         |            |                              |
| 24.05.24                      | 2.000.000                | USD     | 2.002.887         | 0,19                         | 3,95 % 23.05.25             | 2.835.000                | USD     | 2.785.311  | 0,26                         |
| BANCO SANTANDER FRN           |                          |         |                   |                              | CNH INDUSTRIAL CAPITAL      |                          |         |            |                              |
| 14.03.28                      | 4.000.000                | USD     | 4.016.769         | 0,37                         | 5,45 % 14.10.25             | 1.000.000                | USD     | 1.003.243  | 0,09                         |
|                               |                          |         | <b>10.606.876</b> | <b>0,98</b>                  | CONSTELLATION BRANDS        |                          |         |            |                              |
| <b>SCHWEDEN</b>               |                          |         |                   |                              | 4,4 % 15.11.25              | 4.000.000                | USD     | 3.942.876  | 0,36                         |
| SWEDBANK FRN 15.06.2026       | 5.000.000                | USD     | 5.079.595         | 0,47                         | CSX 3,35 % 01.11.25         | 6.503.000                | USD     | 6.328.310  | 0,58                         |
|                               |                          |         | <b>5.079.595</b>  | <b>0,47</b>                  | DUPONT DE NEMOURS           |                          |         |            |                              |
| <b>SCHWEIZ</b>                |                          |         |                   |                              | 4,493 % 15.11.25            | 3.000.000                | USD     | 2.962.127  | 0,27                         |
| CREDIT SUISSE 3,7 %           |                          |         |                   |                              | EL PASO PIPELINE 4,3 %      |                          |         |            |                              |
| 21.02.25                      | 2.000.000                | USD     | 1.966.466         | 0,18                         | 01/05/2024                  | 1.000.000                | USD     | 998.741    | 0,09                         |
| CREDIT SUISSE AGNEW           |                          |         |                   |                              | EXXON MOBIL 0,142 %         |                          |         |            |                              |
| YORK 7,95 % 09.01.25          | 2.000.000                | USD     | 2.033.706         | 0,19                         | 26.06.24                    | 2.000.000                | EUR     | 2.141.412  | 0,20                         |
| UBS GROUP 4,49 % VRN          |                          |         |                   |                              | FORD MOTOR CREDIT 2,3 %     |                          |         |            |                              |
| 05/08/2025                    | 2.670.000                | USD     | 2.657.023         | 0,25                         | 10/02/2025                  | 5.000.000                | USD     | 4.851.237  | 0,45                         |
|                               |                          |         | <b>6.657.195</b>  | <b>0,62</b>                  | GENERAL ELECTRIC FRN        |                          |         |            |                              |
| <b>USA</b>                    |                          |         |                   |                              | 05/05/2026                  | 2.000.000                | USD     | 2.005.878  | 0,19                         |
| AIR LEASE 2,3 % 01.02.25      | 3.000.000                | USD     | 2.914.467         | 0,27                         | GENERAL MOTORS              |                          |         |            |                              |
| AIR LEASE 3,25 %              |                          |         |                   |                              | FINANCIAL FRN 08.05.27      | 10.000.000               | USD     | 10.044.637 | 0,93                         |
| 01/03/2025                    | 3.000.000                | USD     | 2.933.613         | 0,27                         | HEWLETT PACKARD             |                          |         |            |                              |
| AMERICAN EXPRESS FRN          |                          |         |                   |                              | ENTERPRISE 5,9 % 01.10.2024 | 7.000.000                | USD     | 7.013.818  | 0,65                         |
| 04/11/2026                    | 599.000                  | USD     | 599.230           | 0,06                         | JOHN DEERE CAPITAL FRN      |                          |         |            |                              |
| AMERICAN HONDA FINANCE        |                          |         |                   |                              | 08/06/2026                  | 5.808.000                | USD     | 5.857.693  | 0,54                         |
| 4,6 % 17.04.25                | 1.335.000                | USD     | 1.325.230         | 0,12                         | JPMORGAN CHASE 5,546 %      |                          |         |            |                              |
| AMERICAN HONDA FINANCE        |                          |         |                   |                              | VRN 15.12.25                | 2.000.000                | USD     | 1.998.316  | 0,18                         |
| FRN 12.01.26                  | 2.000.000                | USD     | 2.012.793         | 0,19                         | LINDE 4,8 % 05.12.24        | 1.000.000                | USD     | 996.826    | 0,09                         |
| AMGEN 5,25 % 02.03.25         | 1.000.000                | USD     | 996.914           | 0,09                         | LOWES 4,4 % 08.09.25        | 1.000.000                | USD     | 988.433    | 0,09                         |
| AMGEN 5,507 % 02.03.26        | 4.000.000                | USD     | 3.999.615         | 0,37                         | MEAD JOHNSON NUTRITION      |                          |         |            |                              |
| ATT 1,7 % 25.03.26            | 1.000.000                | USD     | 935.381           | 0,09                         | 4,125 % 15.11.25            | 1.000.000                | USD     | 981.564    | 0,09                         |
| ATT 5,539 % 20.02.26          | 2.000.000                | USD     | 2.000.744         | 0,18                         | MERCEDES BENZ FINANCE NORTH |                          |         |            |                              |
| BANK OF AMERICA 4 %           |                          |         |                   |                              | AMERICA 5,5 % 27.11.24      | 1.000.000                | USD     | 1.000.040  | 0,09                         |
| 01/04/2024                    | 2.000.000                | USD     | 2.000.000         | 0,18                         |                             |                          |         |            |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Ultra Short Duration Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl/ Währung<br>Nenn-<br>wert | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung   | Anzahl/ Währung<br>Nenn-<br>wert | Kurswert      | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|----------------------------------|--------------------|------------------------------|--|----------------------------------|---------------|------------------------------|
| MORGAN STANLEY 0,864 %<br>VRN 21.10.25  | 1.000.000                        | USD 972.599        | 0,09                         | <b>AN EINEM ANDEREM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE, ÜBERTRAGBARE<br/>WERTPAPIERE</b> |                                  |               |                              |
| MORGAN STANLEY 3,875 %<br>29.04.24  | 2.000.000                        | USD 1.997.074      | 0,18                         | <b>ANLEIHEN</b>  |                                  |               |                              |
| MORGAN STANLEY BANK FRN<br>16.07.25   | 4.845.000                        | USD 4.864.478      | 0,45                         | <b>AUSTRALIEN</b>  |                                  |               |                              |
| MORGAN STANLEY FRN<br>18.02.26  | 2.000.000                        | USD 2.006.883      | 0,19                         | AUSTRALIA NEW ZEALAND<br>BANKING 4,675 % 15.06.2026                              | 4.000.000                        | USD 3.976.945 | 0,37                         |
| OCCIDENTAL PETROLEUM<br>5,5 % 01.12.25  | 500.000                          | USD 500.001        | 0,05                         | AUSTRALIA NEW ZEALAND<br>BANKING 5,375 % 03.07.25                                | 1.400.000                        | USD 1.404.713 | 0,13                         |
| OCCIDENTAL PETROLEUM<br>5,875 % 01.09.25  | 1.000.000                        | USD 1.004.315      | 0,09                         | AUSTRALIA NEW ZEALAND<br>BANKING FRN 03.07.2025                                  | 3.000.000                        | USD 3.012.860 | 0,28                         |
| PEPSICO FRN 12.11.2024  | 11.033.000                       | USD 11.052.061     | 1,01                         | AUSTRALIA NEW ZEALAND<br>BANKING FRN 03.10.25                                    | 3.000.000                        | USD 3.009.411 | 0,28                         |
| PEPSICO FRN 13.02.26  | 7.020.000                        | USD 7.037.752      | 0,65                         | AUSTRALIA NEW ZEALAND<br>BANKING FRN 18.03.26                                    | 4.000.000                        | USD 4.005.700 | 0,37                         |
| SABINE PASS LIQUEFACTION<br>5,75 % 15.05.24   | 191.000                          | USD 190.711        | 0,02                         | AUSTRALIA NEW ZEALAND<br>BANKING FRN 18.01.27                                    | 8.000.000                        | USD 8.051.396 | 0,73                         |
| SEMPRA ENERGY 5,4 %<br>01/08/2026   | 2.000.000                        | USD 2.009.344      | 0,19                         | COMMONWEALTH BANK OF<br>AUSTRALIA 5,079 % 10.01.25                               | 590.000                          | USD 588.807   | 0,05                         |
| SYNCHRONY BANK 5,4 %<br>22.08.25  | 1.000.000                        | USD 991.715        | 0,09                         | COMMONWEALTH BANK OF<br>AUSTRALIA FRN 10.01.2025                                 | 5.000.000                        | USD 5.010.730 | 0,46                         |
| TMOBILE 3,5 % 15.04.25  | 4.000.000                        | USD 3.922.868      | 0,36                         | COMMONWEALTH BANK OF<br>AUSTRALIA FRN 12.09.25                                   | 2.000.000                        | USD 2.006.153 | 0,19                         |
| TOYOTA MOTOR CREDIT FRN<br>11/09/2025   | 2.000.000                        | USD 2.007.059      | 0,19                         | COMMONWEALTH BANK OF<br>AUSTRALIA FRN 13.03.26                                   | 5.000.000                        | USD 5.021.942 | 0,46                         |
| TOYOTA MOTOR CREDIT FRN<br>18.05.26   | 1.610.000                        | USD 1.624.068      | 0,15                         | COMMONWEALTH BANK OF<br>AUSTRALIAN 5,499 %<br>12/09/2025                         | 2.000.000                        | USD 2.011.693 | 0,19                         |
| VERIZON COMMUNICATIONS<br>FRN 20.03.26  | 8.688.000                        | USD 8.740.159      | 0,81                         | MACQUARIE BANK 5,391 %<br>07/12/2026   | 2.000.000                        | USD 2.010.229 | 0,19                         |
| VMWARE 1 % 15.08.24   | 5.000.000                        | USD 4.913.551      | 0,45                         | MACQUARIE BANK FRN<br>15.06.26   | 3.180.000                        | USD 3.204.548 | 0,30                         |
| WRKCO 3,75 % 15.03.25   | 2.503.000                        | USD 2.460.837      | 0,23                         | MACQUARIE BANK FRN<br>07/12/2026   | 5.000.000                        | USD 5.039.072 | 0,47                         |
| WW GRAINGER 1,85 %<br>15.02.25  | 2.000.000                        | USD 1.940.645      | 0,18                         | MACQUARIE GROUP FRN<br>14.10.25  | 5.000.000                        | USD 4.991.056 | 0,46                         |
|   |                                  | <b>167.585.088</b> | <b>15,48</b>                 | NATIONAL AUSTRALIA BANK<br>4,75 % 10.12.25                                       | 1.960.000                        | USD 1.953.900 | 0,18                         |
| <b>SUMME ANLEIHEN</b>   |                                  | <b>325.482.832</b> | <b>30,07</b>                 | NATIONAL AUSTRALIA BANK<br>5,132 % 22.11.24                                      | 1.715.000                        | USD 1.712.839 | 0,16                         |
| <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>   |                                  |                    |                              | NATIONAL AUSTRALIA BANK<br>FRN 12.01.25  | 1.000.000                        | USD 1.000.266 | 0,09                         |
| <b>USA</b>  |                                  |                    |                              | NATIONAL AUSTRALIA BANK<br>FRN 13.05.25  | 4.000.000                        | USD 4.018.709 | 0,37                         |
| AMERICAN HOMES 3,678 %<br>17.12.36  | 1.617.000                        | USD 1.311.726      | 0,12                         |  |                                  |               |                              |
| AMERICAN HOMES 3,732 %<br>17.10.52  | 3.952.000                        | USD 3.281.083      | 0,30                         |  |                                  |               |                              |
|   |                                  | <b>4.592.809</b>   | <b>0,42</b>                  |  |                                  |               |                              |
| <b>SUMME FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>                                       |                                  | <b>4.592.809</b>   | <b>0,42</b>                  |  |                                  |               |                              |
| <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN<br/>BÖRSE NOTIERTEN WERTPAPIERE<br/>WERTPAPIERE</b> |                                  | <b>330.075.641</b> | <b>30,49</b>                 |  |                                  |               |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Ultra Short Duration Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|--|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|
| NATIONAL AUSTRALIA BANK<br>FRN 10.12.25                   | 4.000.000                | USD     | 4.014.468         | 0,37                         | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT<br>MUTUEL FRN 13.07.2026 | 7.000.000                | USD     | 7.114.109         | 0,67                         |
|   |                          |         | <b>66.045.437</b> | <b>6,10</b>                  | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT<br>MUTUEL FRN 23.01.27   | 4.000.000                | USD     | 4.037.334         | 0,37                         |
| <b>KANADA</b>   |                          |         |                   |                              | BNP PARIBAS 2,819 %<br>VRN 19.11.25                  | 1.970.000                | USD     | 1.932.997         | 0,18                         |
| BANK OF MONTREAL FRN<br>25.09.25                          | 2.000.000                | USD     | 2.013.146         | 0,19                         | BNP PARIBAS 3,375 %<br>09/01/2025                    | 1.000.000                | USD     | 983.652           | 0,09                         |
| BANK OF MONTREAL FRN<br>05/06/2026                        | 5.000.000                | USD     | 5.074.195         | 0,47                         | BNP PARIBAS 4,375 %<br>28.09.25                      | 2.000.000                | USD     | 1.965.409         | 0,18                         |
| BANK OF NOVA SCOTIA<br>FRN 11.04.25                       | 1.000.000                | USD     | 1.005.084         | 0,09                         | BNP PARIBAS 4,375 %<br>12/05/2026                    | 1.000.000                | USD     | 973.722           | 0,09                         |
| BANK OF NOVA SCOTIA<br>FRN 12.06.25                       | 2.000.000                | USD     | 2.014.302         | 0,19                         | BPCE 4,625 % 11.07.24                                | 2.250.000                | USD     | 2.240.204         | 0,21                         |
| BANK OF NOVA SCOTIA<br>FRN 02.03.26                       | 1.000.000                | USD     | 998.202           | 0,09                         | BPCE FRN 14.01.2025                                  | 2.750.000                | USD     | 2.751.816         | 0,25                         |
| BANK OF NOVA SCOTIA<br>FRN 15.09.26                       | 1.000.000                | USD     | 998.162           | 0,09                         | BPCE FRN 19.10.27                                    | 1.000.000                | USD     | 1.016.195         | 0,09                         |
| CANADIAN IMPERIAL BANK<br>OF COMMERCE FRN<br>07.04.25     | 4.000.000                | USD     | 4.022.461         | 0,37                         | CREDIT AGRICOLE 3,25 %<br>04/10/2024                 | 1.000.000                | USD     | 988.219           | 0,09                         |
| CANADIAN IMPERIAL BANK<br>OF COMMERCE 5,144 %<br>28.04.25 | 4.000.000                | USD     | 3.989.879         | 0,37                         | CREDIT AGRICOLE 5,589 %<br>05/07/2026                | 1.000.000                | USD     | 1.008.752         | 0,09                         |
| ROYAL BANK OF CANADA<br>FRN 12.01.26                      | 2.415.000                | USD     | 2.439.509         | 0,23                         | CREDIT AGRICOLE FRN<br>05/07/2026                    | 4.000.000                | USD     | 4.048.830         | 0,37                         |
| ROYAL BANK OF CANADA<br>FRN 20.01.26                      | 1.000.000                | USD     | 998.501           | 0,09                         | CREDIT AGRICOLE FRN<br>11/03/2027                    | 5.000.000                | USD     | 5.012.026         | 0,46                         |
| ROYAL BANK OF CANADA<br>FRN 19.01.27                      | 6.000.000                | USD     | 6.042.058         | 0,56                         | CREDIT AGRICOLE LONDON<br>3,875 % 15.04.24           | 7.000.000                | USD     | 6.996.152         | 0,66                         |
| TORONTODOMINION FRN<br>10/09/2024                         | 2.000.000                | USD     | 2.001.188         | 0,18                         | SOCIETE GENERALE 4,351 %<br>13.06.25                 | 2.000.000                | USD     | 1.977.015         | 0,18                         |
| TORONTODOMINION BANK<br>FRN 05.04.27                      | 5.000.000                | USD     | 5.003.878         | 0,46                         | SOCIETE GENERALE FRN<br>21.01.26                     | 1.000.000                | USD     | 1.001.219         | 0,09                         |
|   |                          |         | <b>36.600.565</b> | <b>3,38</b>                  | SOCIETE GENERALE FRN<br>19.01.28                     | 2.000.000                | USD     | 2.012.837         | 0,19                         |
| <b>CHINA</b>  |                          |         |                   |                              | TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL<br>2,434 % 10.01.25      | 1.000.000                | USD     | 978.579           | 0,09                         |
| ALIBABA GROUP HOLDING<br>3,6 % 28.11.24                   | 750.000                  | USD     | 740.259           | 0,07                         |  |                          |         | <b>48.039.970</b> | <b>4,44</b>                  |
|   |                          |         | <b>740.259</b>    | <b>0,07</b>                  | <b>GROSSBRITANNIEN</b>                               |                          |         |                   |                              |
| <b>DÄNEMARK</b>   |                          |         |                   |                              | BARCLAYS 3,65 % 16.03.2025                           | 3.000.000                | USD     | 2.943.947         | 0,27                         |
| DANSKE BANK 6,259 % VRN<br>22.09.26                       | 4.000.000                | USD     | 4.042.572         | 0,37                         | COCACOLA EUROPEAN<br>PARTNERS 0,8 % 03.05.24         | 7.356.000                | USD     | 7.326.759         | 0,68                         |
|   |                          |         | <b>4.042.572</b>  | <b>0,37</b>                  | NATWEST GROUP FRN<br>01/03/2028                      | 2.000.000                | USD     | 2.010.223         | 0,19                         |
| <b>FINNLAND</b>   |                          |         |                   |                              | STANDARD CHARTERED FRN<br>06/07/2027                 | 3.000.000                | USD     | 3.051.133         | 0,28                         |
| NORDEA BANK FRN<br>19.03.27                               | 5.000.000                | USD     | 5.009.067         | 0,46                         |  |                          |         | <b>15.332.062</b> | <b>1,42</b>                  |
|   |                          |         | <b>5.009.067</b>  | <b>0,46</b>                  | <b>IRLAND</b>  |                          |         |                   |                              |
| <b>FRANKREICH</b>   |                          |         |                   |                              | AERCAP IRELAND CAPITAL<br>6,5 % 15.07.25             | 5.000.000                | USD     | 5.053.163         | 0,47                         |
| BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT<br>MUTUEL FRN 04.02.25        | 1.000.000                | USD     | 1.000.903         | 0,09                         | AERCAP IRELAND CAPITAL<br>DAC 1,65 % 29.10.24        | 5.000.000                | USD     | 4.879.862         | 0,45                         |
|   |                          |         |                   |                              |  |                          |         | <b>9.933.025</b>  | <b>0,92</b>                  |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Ultra Short Duration Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung          | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung                  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|-----------------------|--------------------------|---------|------------------|------------------------------|-------------------------------|--------------------------|---------|------------------|------------------------------|
| <b>ITALIEN</b>        |                          |         |                  |                              | UBS AGLONDON FRN              |                          |         |                  |                              |
| INTESA SANPAOLO 7 %   |                          |         |                  |                              | 11/09/2025                    | 3.000.000                | USD     | 3.017.644        | 0,28                         |
| 21.11.25              | 2.901.000                | USD     | 2.959.965        | 0,27                         |                               |                          |         | <b>6.041.181</b> | <b>0,56</b>                  |
|                       |                          |         | <b>2.959.965</b> | <b>0,27</b>                  | <b>USA</b>                    |                          |         |                  |                              |
| <b>NIEDERLANDE</b>    |                          |         |                  |                              | AMERICAN EXPRESS FRN          |                          |         |                  |                              |
| ABN AMRO BANK 4,8 %   |                          |         |                  |                              | 04/03/2025                    | 3.000.000                | USD     | 3.019.840        | 0,28                         |
| 18.04.26              | 600.000                  | USD     | 589.931          | 0,05                         | AMERICAN HONDA FINANCE        |                          |         |                  |                              |
| COOPERATIEVE RABOBANK |                          |         |                  |                              | FRN 09.01.26                  | 10.000.000               | USD     | 10.027.036       | 0,93                         |
| 2,625 % 22.07.24      | 1.000.000                | USD     | 991.322          | 0,09                         | AT&T FRN 12.06.2024           |                          |         |                  |                              |
| COOPERATIEVE RABOBANK |                          |         |                  |                              | 5,684 % 23.02.26              | 6.000.000                | USD     | 6.163.902        | 0,57                         |
| 5,041 % 05.03.27      | 2.000.000                | USD     | 2.007.939        | 0,19                         | ATHENE GLOBAL FUNDING         |                          |         |                  |                              |
| COOPERATIEVE RABOBANK |                          |         |                  |                              | FRN 24.05.24                  | 11.000.000               | USD     | 11.011.006       | 1,03                         |
| 5,5 % 18.07.25        | 2.000.000                | USD     | 2.008.268        | 0,19                         | ATHENE GLOBAL FUNDING         |                          |         |                  |                              |
| COOPERATIEVE RABOBANK |                          |         |                  |                              | FRN 25.03.27                  | 2.855.000                | USD     | 2.858.136        | 0,26                         |
| FRN 10.01.25          | 4.000.000                | USD     | 4.002.966        | 0,37                         | AVERY DENNISON 0,85 %         |                          |         |                  |                              |
| COOPERATIEVE RABOBANK |                          |         |                  |                              | 15.08.24                      | 3.000.000                | USD     | 2.946.612        | 0,27                         |
| FRN 18.07.25          | 5.000.000                | USD     | 5.019.986        | 0,47                         | AVIATION CAPITAL 4,875 %      |                          |         |                  |                              |
| COOPERATIEVE RABOBANK |                          |         |                  |                              | 01/10/2025                    | 2.000.000                | USD     | 1.964.653        | 0,18                         |
| FRN 09.01.26          | 3.000.000                | USD     | 3.015.180        | 0,28                         | AVIATION CAPITAL              |                          |         |                  |                              |
| COOPERATIEVE RABOBANK |                          |         |                  |                              | 5,5 % 15.12.24                | 1.000.000                | USD     | 996.222          | 0,09                         |
| FRN 18.07.25          | 3.000.000                | USD     | 3.023.465        | 0,28                         | BANK OF AMERICA 4 %           |                          |         |                  |                              |
| COOPERATIEVE RABOBANK |                          |         |                  |                              | 22.01.25                      | 2.000.000                | USD     | 1.972.551        | 0,18                         |
| FRN 09.01.26          | 3.000.000                | USD     | 3.023.465        | 0,28                         | BANK OF AMERICA FRN           |                          |         |                  |                              |
| COOPERATIEVE RABOBANK |                          |         |                  |                              | 18.08.26                      | 1.000.000                | USD     | 1.011.390        | 0,09                         |
| FRN 18.07.25          | 3.000.000                | USD     | 3.023.465        | 0,28                         | BANK OF NEW YORK MELLON       |                          |         |                  |                              |
| COOPERATIEVE RABOBANK |                          |         |                  |                              | 5,224 % VRN 21.11.25          | 2.270.000                | USD     | 2.266.545        | 0,21                         |
| FRN 09.01.26          | 3.000.000                | USD     | 3.023.465        | 0,28                         | BANK OF NEW YORK              |                          |         |                  |                              |
| COOPERATIEVE RABOBANK |                          |         |                  |                              | MELLON FRN 25.10.2024         | 3.000.000                | USD     | 2.999.837        | 0,28                         |
| FRN 18.07.25          | 3.000.000                | USD     | 3.023.465        | 0,28                         | BANK OF NEW YORK              |                          |         |                  |                              |
| COOPERATIEVE RABOBANK |                          |         |                  |                              | MELLON FRN 13.03.26           | 4.545.000                | USD     | 4.549.383        | 0,42                         |
| FRN 09.01.26          | 3.000.000                | USD     | 3.023.465        | 0,28                         | BAXTER INTERNATIONAL          |                          |         |                  |                              |
| COOPERATIEVE RABOBANK |                          |         |                  |                              | 1,322 % 29.11.24              | 4.000.000                | USD     | 3.887.103        | 0,36                         |
| FRN 18.07.25          | 3.000.000                | USD     | 3.023.465        | 0,28                         | BMW US CAPITAL 4,9 %          |                          |         |                  |                              |
| COOPERATIEVE RABOBANK |                          |         |                  |                              | 02/04/2027                    | 1.560.000                | USD     | 1.557.253        | 0,14                         |
| FRN 09.01.26          | 3.000.000                | USD     | 3.023.465        | 0,28                         | BMW US CAPITAL FRN            |                          |         |                  |                              |
| COOPERATIEVE RABOBANK |                          |         |                  |                              | 11/08/2025                    | 3.000.000                | USD     | 3.009.418        | 0,28                         |
| FRN 18.07.25          | 3.000.000                | USD     | 3.023.465        | 0,28                         | BMW US CAPITAL FRN            |                          |         |                  |                              |
| COOPERATIEVE RABOBANK |                          |         |                  |                              | 02/04/2026                    | 4.760.000                | USD     | 4.764.553        | 0,44                         |
| FRN 09.01.26          | 3.000.000                | USD     | 3.023.465        | 0,28                         | BRISTOLMYERS SQUIBB FRN       |                          |         |                  |                              |
| COOPERATIEVE RABOBANK |                          |         |                  |                              | 20.02.26                      | 5.000.000                | USD     | 5.015.537        | 0,46                         |
| FRN 18.07.25          | 3.000.000                | USD     | 3.023.465        | 0,28                         | CAPITAL ONE FINANCIAL         |                          |         |                  |                              |
| COOPERATIEVE RABOBANK |                          |         |                  |                              | 4,166 % VRN 09.05.25          | 6.955.000                | USD     | 6.941.093        | 0,64                         |
| FRN 09.01.26          | 3.000.000                | USD     | 3.023.465        | 0,28                         | CARRIER GLOBAL 5,8 %          |                          |         |                  |                              |
| COOPERATIEVE RABOBANK |                          |         |                  |                              | 30.11.25                      | 4.650.000                | USD     | 4.684.294        | 0,43                         |
| FRN 18.07.25          | 3.000.000                | USD     | 3.023.465        | 0,28                         | CATERPILLAR FINANCIAL         |                          |         |                  |                              |
| COOPERATIEVE RABOBANK |                          |         |                  |                              | SERVICES FRN 13.06.25         | 1.900.000                | USD     | 1.908.865        | 0,18                         |
| FRN 09.01.26          | 3.000.000                | USD     | 3.023.465        | 0,28                         | CELANESE US HOLDINGS          |                          |         |                  |                              |
| COOPERATIEVE RABOBANK |                          |         |                  |                              | 3,5 % 08.05.24                | 1.000.000                | USD     | 997.582          | 0,09                         |
| FRN 18.07.25          | 3.000.000                | USD     | 3.023.465        | 0,28                         | CHARTER COMMUNICATIONS OPERA- |                          |         |                  |                              |
| COOPERATIEVE RABOBANK |                          |         |                  |                              | TING 4,908 % 23.07.25         | 1.000.000                | USD     | 988.539          | 0,09                         |
| FRN 09.01.26          | 3.000.000                | USD     | 3.023.465        | 0,28                         |                               |                          |         |                  |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Ultra Short Duration Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert   | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert   | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--------------------------|---------|------------|------------------------------|--|--------------------------|---------|------------|------------------------------|
| CHENIERE CORPUS CHRISTI<br>HOLDINGS 5,875 % 31.03.25   | 5.000.000                | USD     | 5.004.108  | 0,46                         | JPMORGAN CHASE BANK<br>5,11 % 08.12.26                 | 2.000.000                | USD     | 2.006.901  | 0,19                         |
| CITIBANK FRN 29.09.2025                                | 3.000.000                | USD     | 3.015.866  | 0,28                         | JPMORGAN CHASE BANK FRN<br>08/12/2026                  | 6.000.000                | USD     | 6.093.087  | 0,56                         |
| CITIBANK FRN 04.12.26                                  | 1.000.000                | USD     | 1.012.431  | 0,09                         | JPMORGAN CHASE FRN<br>14.06.25                         | 1.000.000                | USD     | 1.001.295  | 0,09                         |
| CITIGROUP 0,776 % VRN<br>30.10.24                      | 2.000.000                | USD     | 2.002.768  | 0,19                         | KENVUE 5,5 % 22.03.25                                  | 665.000                  | USD     | 666.575    | 0,06                         |
| COMCAST 3,7 % 15.04.2024                               | 1.000.000                | USD     | 999.660    | 0,09                         | MASSMUTUAL GLOBAL<br>FUNDING FRN 10.07.26              | 8.000.000                | USD     | 8.058.121  | 0,74                         |
| COMCAST FRN 15.04.2024                                 | 1.000.000                | USD     | 998.675    | 0,09                         | MASSMUTUAL GLOBAL<br>FUNDING FRN 29.01.27              | 5.000.000                | USD     | 5.008.765  | 0,46                         |
| CONSTELLATION BRANDS<br>4,75 % 15.11.24                | 6.300.000                | USD     | 6.271.231  | 0,58                         | MERCEDESSENZ FINANCE NORTH<br>AMERICA 4,95 % 30.03.25  | 500.000                  | USD     | 497.989    | 0,05                         |
| COREBRIDGE FINANCIAL<br>3,5 % 04.04.25                 | 1.000.000                | USD     | 979.648    | 0,09                         | MERCEDESSENZ FINANCE NORTH<br>AMERICA 5,375 % 01.08.25 | 2.000.000                | USD     | 2.004.969  | 0,19                         |
| CRESTWOOD MIDSTREAM<br>PARTNERS 5,75 % 01.04.25        | 4.000.000                | USD     | 3.998.634  | 0,37                         | MERCEDESSENZ FINANCE NORTH<br>AMERICA FRN 30.03.2025   | 3.000.000                | USD     | 3.021.679  | 0,28                         |
| DAIMLER TRUCKS FINANCE NORTH<br>AMERICA 5,2 % 17.01.25 | 165.000                  | USD     | 164.490    | 0,02                         | MERCEDESSENZ FINANCE NORTH<br>AMERICA FRN 01.08.25     | 4.000.000                | USD     | 4.008.427  | 0,37                         |
| DAIMLER TRUCK FINANCE NORTH<br>AMERICA 5,6 % 08.08.25  | 2.000.000                | USD     | 2.003.075  | 0,19                         | MERCEDESSENZ FINANCE NORTH<br>AMERICA FRN 09.01.26     | 8.000.000                | USD     | 8.020.751  | 0,74                         |
| DAIMLER TRUCK FINANCE NORTH<br>AMERICA FRN 13.12.24    | 1.000.000                | USD     | 1.002.610  | 0,09                         | METROPOLITAN LIFE GLOBAL<br>FUNDING 2,8 % 21.03.25     | 1.430.000                | USD     | 1.395.272  | 0,13                         |
| DAIMLER TRUCKS FINANCE NORTH<br>AMERICA FRN 05.04.24   | 5.000.000                | USD     | 5.000.000  | 0,46                         | METROPOLITAN LIFE GLOBAL<br>FUNDING FRN 27.09.2024     | 2.000.000                | USD     | 2.001.457  | 0,18                         |
| DELL INTERNATIONAL 4 %<br>15.07.24                     | 6.000.000                | USD     | 5.970.803  | 0,55                         | METROPOLITAN LIFE GLOBAL<br>FUNDING FRN 21.03.25       | 2.000.000                | USD     | 2.011.807  | 0,19                         |
| DELL INTERNATIONAL<br>5,85 % 15.07.25                  | 5.000.000                | USD     | 5.027.408  | 0,46                         | MILEAGE PLUS HOLDINGS<br>6,5 % 20.06.27                | 8.000.000                | USD     | 5.643.736  | 0,52                         |
| EMD FINANCE 3,25 %<br>19.03.25                         | 9.070.000                | USD     | 8.879.726  | 0,82                         | MORGAN STANLEY BANK<br>5,479 % 16.07.25                | 630.000                  | USD     | 632.712    | 0,06                         |
| FG GLOBAL FUNDING 0,9 %<br>20.09.24                    | 1.000.000                | USD     | 976.447    | 0,09                         | NATIONAL RURAL<br>UTILITIES COOPERATION FRN 05.02.2027 | 7.000.000                | USD     | 7.038.805  | 0,65                         |
| FORD MOTOR CREDIT<br>5,8 % 05.03.27                    | 665.000                  | USD     | 668.198    | 0,06                         | NEW YORK LIFE GLOBAL<br>FUNDING 4,9 % 02.04.27         | 1.000.000                | USD     | 999.480    | 0,09                         |
| FOX 3,05 % 07.04.25                                    | 6.000.000                | USD     | 5.853.088  | 0,54                         | NEW YORK LIFE GLOBAL<br>FUNDING FRN 02.04.26           | 8.000.000                | USD     | 8.047.714  | 0,74                         |
| GENERAL MOTORS<br>FINANCIAL FRN 15.10.24               | 3.000.000                | USD     | 3.003.073  | 0,28                         | NEW YORK LIFE GLOBAL<br>FUNDING FRN 02.04.27           | 4.000.000                | USD     | 4.000.000  | 0,37                         |
| GENERAL MOTORS<br>FINANCIAL FRN 07.04.2025             | 2.000.000                | USD     | 2.013.927  | 0,19                         | NEWMONT CORP NEWCREST<br>FINANCE 5,3 % 15.03.26        | 5.000.000                | USD     | 5.015.158  | 0,46                         |
| GOLDMAN SACHS GROUP FRN<br>21.10.24                    | 6.000.000                | USD     | 6.004.887  | 0,55                         | NEXTERA ENERGY CAPITAL<br>HOLDINGS 4,95 % 29.01.26     | 1.500.000                | USD     | 1.494.212  | 0,14                         |
| GOLDMAN SACHS GROUP FRN<br>15.05.26                    | 6.000.000                | USD     | 6.054.553  | 0,56                         | NEXTERA ENERGY CAPITAL<br>HOLDINGS FRN 29.01.2026      | 10.000.000               | USD     | 10.014.612 | 0,93                         |
| GOLDMAN SACHS BANK FRN<br>18.03.27                     | 4.000.000                | USD     | 3.999.684  | 0,37                         | ROCHE HOLDINGS FRN<br>10/03/2025                       | 3.000.000                | USD     | 3.011.334  | 0,28                         |
| JOHN DEERE CAPITAL FRN<br>06/03/2026                   | 10.000.000               | USD     | 10.009.359 | 0,92                         |  |                          |         |            |                              |
| JPMORGAN CHASE 0,969 %<br>VRN 23.06.25                 | 3.000.000                | USD     | 2.965.491  | 0,27                         |  |                          |         |            |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Ultra Short Duration Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung                                      | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung                                       | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|--------------------|------------------------------|--|--------------------------|---------|--------------------|------------------------------|
| ROCHE HOLDINGS FRN<br>13.11.26                    | 6.250.000                | USD     | 6.290.917          | 0,58                         | BX TRUST FRN 15.11.32                              | 9.730.000                | USD     | 1.846.271          | 0,17                         |
| SABINE PASS<br>LIQUEFACTION 5,625 %<br>01/03/2025 | 2.000.000                | USD     | 1.999.021          | 0,18                         | CAMB COMMERCIAL FRN<br>15.12.37                    | 6.000.000                | USD     | 6.003.298          | 0,55                         |
| SANTANDER HOLDINGS<br>4,26 % VRN 09.06.25         | 4.000.000                | USD     | 3.980.221          | 0,37                         | CIFC FUNDING FRN<br>18.07.31                       | 5.000.000                | USD     | 4.886.437          | 0,45                         |
| SHERWIN WILLIAMS 4,05 %<br>08/08/2024             | 2.000.000                | USD     | 1.987.636          | 0,18                         | CIFC FUNDING FRN<br>20.04.32                       | 5.000.000                | USD     | 5.004.750          | 0,46                         |
| SPRINT 7,125 % 15.06.24                           | 2.892.000                | USD     | 2.900.071          | 0,27                         | DBCG MORTGAGE TRUST FRN<br>15.06.34                | 6.000.000                | USD     | 6.015.299          | 0,56                         |
| SPRINT 7,625 % 15.02.25                           | 3.000.000                | USD     | 3.038.459          | 0,28                         | DBGS BIOD MORTGAGE<br>TRUST FRN 15.05.35           | 7.830.593                | USD     | 7.138.917          | 0,66                         |
| SPRINT CORP 7,625 %<br>01/03/2026                 | 2.000.000                | USD     | 2.066.095          | 0,19                         | GALAXY XX CLO FRN<br>20.04.31                      | 5.500.000                | USD     | 4.641.968          | 0,43                         |
| TOYOTA MOTOR CREDIT<br>4,8 % 05.01.26             | 2.000.000                | USD     | 1.994.589          | 0,18                         | INVITATION HOMES FRN<br>17.01.38                   | 3.000.000                | USD     | 3.006.533          | 0,28                         |
| TOYOTA MOTOR CREDIT FRN<br>05/01/2026             | 2.000.000                | USD     | 2.008.525          | 0,19                         | INVITATION HOMES TRUST<br>FRN 17.01.38             | 5.500.000                | USD     | 4.647.108          | 0,43                         |
| TOYOTA MOTOR CREDIT FRN<br>19.03.27               | 4.000.000                | USD     | 3.998.296          | 0,37                         | MORGAN STANLEY CAPITAL<br>FRN 15.12.38             | 3.000.000                | USD     | 2.844.127          | 0,26                         |
| US (GOVT) FRN 30.04.2025                          | 10.500.000               | USD     | 10.505.078         | 0,98                         | NYT MORTGAGE TRUST FRN<br>15.11.35                 | 3.810.000                | USD     | 3.717.117          | 0,34                         |
| US (GOVT) FRN 31.10.25                            | 35.750.000               | USD     | 35.757.850         | 3,31                         |  |                          |         | <b>53.230.843</b>  | <b>4,91</b>                  |
| VENTAS REALTY 3,5 %<br>15.04.24                   | 1.697.000                | USD     | 1.695.519          | 0,16                         | <b>SUMME FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>      |                          |         | <b>56.774.044</b>  | <b>5,24</b>                  |
| VERIZON COMMUNICATIONS<br>3,376 % 15.02.25        | 1.000.000                | USD     | 982.173            | 0,09                         | <b>SUMME DER AN EINER GEREGELTEN</b>               |                          |         | <b>676.957.621</b> | <b>62,54</b>                 |
| VMWARE 4,5 % 15.05.25                             | 5.000.000                | USD     | 4.953.714          | 0,46                         | <b>MARKT GEHANDELTEN ÜBERTRAGBAREN WERTPAPIERE</b> |                          |         |                    |                              |
| WELLS FARGO BANK 5,55 %<br>01/08/2025             | 1.000.000                | USD     | 1.005.372          | 0,09                         | <b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>           |                          |         |                    |                              |
| WELLS FARGO BANK FRN<br>01/08/2025                | 3.000.000                | USD     | 3.012.144          | 0,28                         | <b>LUXEMBURG</b>                                   |                          |         |                    |                              |
| WELLS FARGO BANK FRN<br>11/12/2026                | 5.000.000                | USD     | 5.065.641          | 0,47                         | HGIF GLOBAL ASSET<br>BACKED BOND „Z“               | 264.547                  | USD     | 45.509.238         | 4,20                         |
|   |                          |         | <b>370.402.098</b> | <b>34,22</b>                 |  |                          |         | <b>45.509.238</b>  | <b>4,20</b>                  |
| <b>SUMME ANLEIHEN</b>                             |                          |         | <b>620.183.577</b> | <b>57,30</b>                 | <b>SUMME ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>     |                          |         | <b>45.509.238</b>  | <b>4,20</b>                  |
| <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>           |                          |         |                    |                              | <b>GELDMARKTINSTRUMENTE</b>                        |                          |         |                    |                              |
| <b>GROSSBRITANNIEN</b>                            |                          |         |                    |                              | <b>COMMERCIAL PAPER</b>                            |                          |         |                    |                              |
| SILVERSTONE MASTER<br>ISSUER FRN 21.01.2070       | 1.500.000                | USD     | 870.375            | 0,08                         | <b>USA</b>   |                          |         |                    |                              |
|   |                          |         | <b>870.375</b>     | <b>0,08</b>                  | WRKCO 0 % 03.04.24                                 | 1.650.000                | USD     | 1.648.471          | 0,15                         |
| <b>IRLAND</b>                                     |                          |         |                    |                              | WRKCO 0 % 17.04.24                                 | 2.000.000                | USD     | 1.993.889          | 0,19                         |
| INVESCO EURO CLO FRN<br>15.07.31                  | 2.500.000                | EUR     | 2.672.826          | 0,25                         |  |                          |         | <b>3.642.360</b>   | <b>0,34</b>                  |
|   |                          |         | <b>2.672.826</b>   | <b>0,25</b>                  | <b>TOTAL COMMERCIAL PAPER</b>                      |                          |         | <b>3.642.360</b>   | <b>0,34</b>                  |
| <b>USA</b>  |                          |         |                    |                              | <b>SCHATZWECHSEL</b>                               |                          |         |                    |                              |
| AMERICAN HOMES 3,467 %<br>17.04.52                | 2.000.000                | USD     | 1.626.287          | 0,15                         | <b>USA</b>   |                          |         |                    |                              |
| AMMC CLO FRN 26.05.31                             | 2.750.000                | USD     | 1.852.731          | 0,17                         | US (GOVT) 0 % 11.04.24                             | 5.000.000                | USD     | 4.992.742          | 0,46                         |
|   |                          |         |                    |                              | US (GOVT) 0 % 16.04.24                             | 9.500.000                | USD     | 9.479.181          | 0,88                         |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Ultra Short Duration Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung                                   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert             | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--------------------------|---------|----------------------|------------------------------|
| US (GOVT) 0 % 23.04.24                         | 4.000.000                | USD     | 3.987.130            | 0,37                         |
|  |                          |         | <b>18.459.053</b>    | <b>1,71</b>                  |
| <b>SUMME SCHATZWECHSEL</b>                     |                          |         | <b>18.459.053</b>    | <b>1,71</b>                  |
| <b>GELDMARKTINSTRUMENTE GESAMT</b>             |                          |         | <b>22.101.413</b>    | <b>2,05</b>                  |
| <b>SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>       |                          |         |                      |                              |
| <b>ANLEIHEN</b>                                |                          |         |                      |                              |
| <b>KANADA</b>                                  |                          |         |                      |                              |
| BANK OF MONTREAL FRN<br>09/07/2024             | 3.000.000                | USD     | 3.000.877            | 0,28                         |
|  |                          |         | <b>3.000.877</b>     | <b>0,28</b>                  |
| <b>USA</b>                                     |                          |         |                      |                              |
| AMERICAN HONDA FINANCE<br>FRN 07.06.24         | 2.389.000                | USD     | 2.390.748            | 0,22                         |
|  |                          |         | <b>2.390.748</b>     | <b>0,22</b>                  |
| <b>SUMME ANLEIHEN</b>                          |                          |         | <b>5.391.625</b>     | <b>0,50</b>                  |
| <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>        |                          |         |                      |                              |
| <b>AUSTRALIEN</b>                              |                          |         |                      |                              |
| RESIMAC BASTILLE TRUST<br>SERIESFRN 09.09.2053 | 4.250.000                | USD     | 1.929.085            | 0,18                         |
|  |                          |         | <b>1.929.085</b>     | <b>0,18</b>                  |
| <b>CHINA</b>                                   |                          |         |                      |                              |
| VENTURE XXVIII CLO FRN<br>20.07.30             | 4.500.000                | USD     | 3.772.779            | 0,34                         |
|  |                          |         | <b>3.772.779</b>     | <b>0,34</b>                  |
| <b>USA</b>                                     |                          |         |                      |                              |
| CIFC FUNDING FRN<br>17.10.31                   | 1.050.000                | USD     | 1.041.545            | 0,10                         |
|  |                          |         | <b>1.041.545</b>     | <b>0,10</b>                  |
| <b>SUMME FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>  |                          |         | <b>6.743.409</b>     | <b>0,62</b>                  |
| <b>SUMME SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |                          |         | <b>12.135.034</b>    | <b>1,12</b>                  |
| <b>SUMME WERTPAPIERANLAGEN</b>                 |                          |         | <b>1.086.778.947</b> | <b>100,40</b>                |
| <b>SONSTIGE NETTOVERBINDLICHKEITEN</b>         |                          |         | <b>(4.315.824)</b>   | <b>(0,40)</b>                |
| <b>GESAMTNETTOVERMÖGEN</b>                     |                          |         | <b>1.082.463.123</b> | <b>100,00</b>                |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

US Dollar Bond

Aufstellung der Wertpapiieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|------------------|------------------------------|--|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|
| <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>  |                          |         |                  |                              | <b>ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP</b>                  |                          |         |                   |                              |
| <b>AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |                          |         |                  |                              | 3,754 % VRN 11.01.29                                 |                          |         |                   |                              |
| <b>ANLEIHEN</b>   |                          |         |                  |                              | 200.000 USD 196.896 0,06                             |                          |         |                   |                              |
| <b>KANADA</b>   |                          |         |                  |                              | STANDARD CHARTERED                                   |                          |         |                   |                              |
| BANK OF MONTREAL 5,3 %<br>05/06/2026                              | 2.850.000                | USD     | 2.859.567        | 0,86                         | 1,822 % 23.11.25                                     | 1.000.000                | USD     | 972.988           | 0,29                         |
| CANADIAN IMPERIAL BANK OF<br>COMMERCE 5,001 % 4.28.2028           | 920.000                  | USD     | 918.447          | 0,27                         | STANDARD CHARTERED                                   |                          |         |                   |                              |
| ROYAL BANK OF CANADA  |                          |         |                  |                              | 6,097 % VRN 11.01.35                                 | 2.840.000                | USD     | 2.922.499         | 0,86                         |
| 5,15 % 01.02.34   | 730.000                  | USD     | 731.941          | 0,22                         |  |                          |         | <b>12.824.124</b> | <b>3,83</b>                  |
| ROYAL BANK OF CANADA  |                          |         |                  |                              | <b>IRLAND</b>  |                          |         |                   |                              |
| 5,2 % 20.07.26  | 1.000.000                | USD     | 1.003.884        | 0,30                         | AERCAP IRELAND CAPITAL                               |                          |         |                   |                              |
| ROYAL BANK OF CANADA  |                          |         |                  |                              | 4,45 % 01.10.25                                      |                          |         |                   |                              |
| 5,66 % 25.10.24   | 1.000.000                | USD     | 1.000.985        | 0,30                         | 280.000 USD 275.855 0,08                             |                          |         |                   |                              |
| WASTE CONNECTIONS 2,2 %<br>15.01.32                               | 410.000                  | USD     | 336.668          | 0,10                         | <b>275.855 0,08</b>                                  |                          |         |                   |                              |
|   |                          |         | <b>6.851.492</b> | <b>2,05</b>                  | <b>NIEDERLANDE</b>                                   |                          |         |                   |                              |
| <b>FRANKREICH</b>   |                          |         |                  |                              | AERCAP HOLDINGS 5,875 %<br>VRN 10.10.79              |                          |         |                   |                              |
| BNP PARIBAS 5,894 % VRN<br>05/12/2034                             | 785.000                  | USD     | 822.010          | 0,25                         | 310.000 USD 308.351 0,09                             |                          |         |                   |                              |
|   |                          |         | <b>822.010</b>   | <b>0,25</b>                  | <b>308.351 0,09</b>                                  |                          |         |                   |                              |
| <b>DEUTSCHLAND</b>  |                          |         |                  |                              | <b>SPANIEN</b>                                       |                          |         |                   |                              |
| DEUTSCHE BANK 2,129 %<br>VRN 24.11.26                             | 565.000                  | USD     | 533.303          | 0,16                         | BANCO SANTANDER 6,921 %<br>08/08/2033                |                          |         |                   |                              |
| DEUTSCHE BANK 3,035 %<br>VRN 28.05.32                             | 595.000                  | USD     | 502.516          | 0,15                         | 600.000 USD 628.649 0,19                             |                          |         |                   |                              |
|   |                          |         | <b>1.035.819</b> | <b>0,31</b>                  | <b>628.649 0,19</b>                                  |                          |         |                   |                              |
| <b>GROSSBRITANNIEN</b>  |                          |         |                  |                              | <b>USA</b>   |                          |         |                   |                              |
| BARCLAYS 5,69 % VRN<br>12/03/2030                                 | 910.000                  | USD     | 915.085          | 0,27                         | ALEXANDRIA REAL ESTATE<br>EQUITIES 5,15 % 15.04.2053 |                          |         |                   |                              |
| BARCLAYS 6,692 % VRN<br>13.09.34                                  | 900.000                  | USD     | 960.870          | 0,29                         | AMERICAN TOWER 5,25 %<br>15.07.28                    |                          |         |                   |                              |
| BARCLAYS 7,325 % VRN<br>02/11/2026                                | 1.080.000                | USD     | 1.106.796        | 0,33                         | 500.000 USD 500.779 0,15                             |                          |         |                   |                              |
| BP CAPITAL MARKETS<br>4,375 % VRN PERP                            | 121.000                  | USD     | 118.919          | 0,04                         | ASHTREAD CAPITAL 5,95 %<br>15.10.33                  |                          |         |                   |                              |
| DIAGEO CAPITAL 5,2 %<br>24.10.25                                  | 1.000.000                | USD     | 1.001.707        | 0,30                         | 595.000 USD 602.364 0,18                             |                          |         |                   |                              |
| NATIONAL GRID 5,418 %<br>11/01/2034                               | 2.470.000                | USD     | 2.458.480        | 0,74                         | BANK OF AMERICA 2,299 %<br>VRN 21.07.32              |                          |         |                   |                              |
| NATIONWIDE BUILDING SOCIETY<br>6,557 % VRN 10.18.2027             | 965.000                  | USD     | 990.760          | 0,30                         | 650.000 USD 533.369 0,16                             |                          |         |                   |                              |
| NATWEST GROUP 1,642 %<br>VRN 14.06.27                             | 480.000                  | USD     | 441.648          | 0,13                         | BANK OF AMERICA 5,202 %<br>VRN 25.04.29              |                          |         |                   |                              |
| NATWEST MARKETS 1,6 %<br>29.09.26                                 | 525.000                  | USD     | 480.530          | 0,14                         | 1.000.000 USD 1.001.875 0,30                         |                          |         |                   |                              |
| ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP<br>3,073 % VRN 22.05.2028            | 275.000                  | USD     | 256.946          | 0,08                         | BANK OF AMERICA 5,468 %<br>VRN 23.01.35              |                          |         |                   |                              |
|   |                          |         |                  |                              | 1.780.000 USD 1.795.670 0,54                         |                          |         |                   |                              |
|   |                          |         |                  |                              | BANK OF AMERICA 5,872 %<br>VRN 15.09.34              |                          |         |                   |                              |
|   |                          |         |                  |                              | 2.920.000 USD 3.032.283 0,91                         |                          |         |                   |                              |
|   |                          |         |                  |                              | BANK OF NEW YORK MELLON<br>4,947 % VRN 26.04.2027    |                          |         |                   |                              |
|   |                          |         |                  |                              | 1.140.000 USD 1.135.564 0,34                         |                          |         |                   |                              |
|   |                          |         |                  |                              | BOARDWALK PIPELINES<br>5,95 % 01.06.26               |                          |         |                   |                              |
|   |                          |         |                  |                              | 138.000 USD 139.341 0,04                             |                          |         |                   |                              |
|   |                          |         |                  |                              | COCACOLA 3,45 % 25.03.2030                           |                          |         |                   |                              |
|   |                          |         |                  |                              | 2.000.000 USD 1.884.140 0,56                         |                          |         |                   |                              |
|   |                          |         |                  |                              | ELI LILLY 5 % 09.02.2054                             |                          |         |                   |                              |
|   |                          |         |                  |                              | 1.340.000 USD 1.336.987 0,40                         |                          |         |                   |                              |
|   |                          |         |                  |                              | ENERGY TRANSFER 5,95 %<br>15.05.54                   |                          |         |                   |                              |
|   |                          |         |                  |                              | 655.000 USD 654.573 0,20                             |                          |         |                   |                              |
|   |                          |         |                  |                              | EXELON 5,15 % 15.03.29                               |                          |         |                   |                              |
|   |                          |         |                  |                              | 710.000 USD 712.042 0,21                             |                          |         |                   |                              |
|   |                          |         |                  |                              | FORD MOTOR CREDIT<br>6,798 % 07.11.28                |                          |         |                   |                              |
|   |                          |         |                  |                              | 200.000 USD 208.861 0,06                             |                          |         |                   |                              |
|   |                          |         |                  |                              | GENERAL MOTORS<br>FINANCIAL 5,8 % 07.01.29           |                          |         |                   |                              |
|   |                          |         |                  |                              | 1.725.000 USD 1.757.697 0,53                         |                          |         |                   |                              |
|   |                          |         |                  |                              | HCA 5,9 % 01.06.53                                   |                          |         |                   |                              |
|   |                          |         |                  |                              | 415.000 USD 418.697 0,13                             |                          |         |                   |                              |
|   |                          |         |                  |                              | HCA 6 % 01.04.54                                     |                          |         |                   |                              |
|   |                          |         |                  |                              | 1.720.000 USD 1.751.534 0,52                         |                          |         |                   |                              |
|   |                          |         |                  |                              | HCA 6,1 % 01.04.64                                   |                          |         |                   |                              |
|   |                          |         |                  |                              | 2.330.000 USD 2.364.754 0,71                         |                          |         |                   |                              |
|   |                          |         |                  |                              | JPMORGAN CHASE 4,6 % VRN<br>PERP                     |                          |         |                   |                              |
|   |                          |         |                  |                              | 1.520.000 USD 1.499.609 0,45                         |                          |         |                   |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

US Dollar Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung                                   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert   | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--------------------------|---------|------------|------------------------------|--|--------------------------|---------|--------------------|------------------------------|
| JPMORGAN CHASE 5,299 %<br>VRN 24.07.29         | 1.100.000                | USD     | 1.109.468  | 0,33                         | US BANCORP 5,678 % VRN<br>23.01.35   | 905.000                  | USD     | 915.788            | 0,27                         |
| JPMORGAN CHASE 5,336 %<br>VRN 23.01.35         | 1.050.000                | USD     | 1.055.471  | 0,32                         | WASTE MANAGEMENT 4,875 %<br>15.02.29   | 2.945.000                | USD     | 2.976.444          | 0,89                         |
| MICROSOFT 3,3 % 06.02.2027                     | 2.500.000                | USD     | 2.426.006  | 0,73                         |  |                          |         | <b>156.943.456</b> | <b>46,93</b>                 |
| MORGAN STANLEY 5,164 %<br>VRN 20.04.29         | 700.000                  | USD     | 699.972    | 0,21                         | <b>SUMME ANLEIHEN</b>  |                          |         | <b>179.689.756</b> | <b>53,73</b>                 |
| MORGAN STANLEY 5,466 %<br>VRN 18.01.35         | 785.000                  | USD     | 794.492    | 0,24                         | <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>  |                          |         |                    |                              |
| MPLX 5,65 % 01.03.53                           | 185.000                  | USD     | 181.078    | 0,05                         | <b>USA</b>   |                          |         |                    |                              |
| SEMPRA ENERGY 5,5 %<br>01/08/2033              | 1.035.000                | USD     | 1.039.628  | 0,31                         | FNMA 2,00 % TBA 15.04.2036   | 8.350.000                | USD     | 7.408.671          | 2,22                         |
| SYNCHRONY BANK 5,4 %<br>22.08.25               | 435.000                  | USD     | 431.396    | 0,13                         | FNMA 2,00 % TBA 15.04.51   | 13.740.000               | USD     | 10.893.897         | 3,25                         |
| TARGA RESOURCES                                |                          |         |            |                              | FNMA 2,50 % TBA 15.04.51   | 12.240.000               | USD     | 10.143.598         | 3,03                         |
| PARTNERS 6,15 % 01.03.29                       | 1.155.000                | USD     | 1.204.554  | 0,36                         | GNMA 2,50 % TBA 15.04.2051   | 4.680.000                | USD     | 3.998.292          | 1,20                         |
| TMOBILE 5,05 % 15.07.2033                      | 460.000                  | USD     | 455.657    | 0,14                         |  |                          |         | <b>32.444.458</b>  | <b>9,70</b>                  |
| TMOBILE 5,5 % 15.01.55                         | 350.000                  | USD     | 350.348    | 0,10                         | <b>SUMME FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>                                    |                          |         | <b>32.444.458</b>  | <b>9,70</b>                  |
| TMOBILE US 5,75 % 15.01.2034                   | 475.000                  | USD     | 495.730    | 0,15                         | <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN<br/>BÖRSE NOTIERTEN WERTPAPIERE</b>              |                          |         | <b>212.134.214</b> | <b>63,43</b>                 |
| UNITED STATES TREASURY<br>NOTE 4,25 % 15.03.27 | 4.700.000                | USD     | 4.681.824  | 1,40                         | <b>WERTPAPIERE</b>   |                          |         |                    |                              |
| US (GOVT) 3,625 % 15.05.26                     | 1.600.000                | USD     | 1.569.250  | 0,47                         | <b>AN EINEM ANDEREM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE, ÜBERTRAGBARE<br/>WERTPAPIERE</b> |                          |         |                    |                              |
| US (GOVT) 3,625 % 15.02.53                     | 1.530.000                | USD     | 1.348.073  | 0,40                         | <b>ANLEIHEN</b>  |                          |         |                    |                              |
| US (GOVT) 3,625 % 15.05.53                     | 2.045.000                | USD     | 1.802.795  | 0,54                         | <b>BELGIEN</b>   |                          |         |                    |                              |
| US (GOVT) 3,75 % 31.12.28                      | 5.866.000                | USD     | 5.747.534  | 1,72                         | KBC GROUP 6,324 % VRN<br>21.09.34  | 990.000                  | USD     | 1.040.877          | 0,31                         |
| US (GOVT) 3,75 % 31.12.30                      | 18.450.000               | USD     | 17.961.364 | 5,36                         |  |                          |         | <b>1.040.877</b>   | <b>0,31</b>                  |
| US (GOVT) 3,875 % 15.02.43                     | 3.513.000                | USD     | 3.258.033  | 0,97                         | <b>KANADA</b>  |                          |         |                    |                              |
| US (GOVT) 4 % 15.01.2027                       | 10.000.000               | USD     | 9.887.500  | 2,96                         | NATIONAL BANK OF CANADA<br>3,75 % VRN 09.06.25                                   | 1.000.000                | USD     | 995.714            | 0,30                         |
| US (GOVT) 4 % 31.01.29                         | 5.070.000                | USD     | 5.023.063  | 1,50                         | NATIONAL BANK OF CANADA<br>5,6 % 18.12.28  | 595.000                  | USD     | 605.701            | 0,18                         |
| US (GOVT) 4 % 31.01.31                         | 5.200.000                | USD     | 5.138.656  | 1,54                         | TORONTODOMINION BANK<br>4,994 % 05.04.29   | 1.500.000                | USD     | 1.500.001          | 0,45                         |
| US (GOVT) 4,125 % 15.02.27                     | 1.000.000                | USD     | 992.344    | 0,30                         | WASTE CONNECTIONS 4,2 %<br>15.01.33  | 95.000                   | USD     | 89.537             | 0,03                         |
| US (GOVT) 4,125 % 31.07.28                     | 9.520.000                | USD     | 9.471.284  | 2,83                         |  |                          |         | <b>3.190.953</b>   | <b>0,96</b>                  |
| US (GOVT) 4,125 % 15.08.53                     | 12.713.000               | USD     | 12.260.099 | 3,67                         | <b>FRANKREICH</b>  |                          |         |                    |                              |
| US (GOVT) 4,25 % 31.12.25                      | 5.000.000                | USD     | 4.961.426  | 1,48                         | BNP PARIBAS SA 2,819 %<br>VRN 19.11.25   | 1.250.000                | USD     | 1.226.521          | 0,37                         |
| US (GOVT) 4,25 % 28.02.31                      | 3.100.000                | USD     | 3.109.445  | 0,93                         | CREDIT AGRICOLE 5,335 %<br>VRN 10.01.30  | 2.660.000                | USD     | 2.656.021          | 0,79                         |
| US (GOVT) 4,375 % 15.12.26                     | 14.000.000               | USD     | 13.976.485 | 4,18                         |  |                          |         |                    |                              |
| US (GOVT) 4,375 % 30.11.30                     | 1.100.000                | USD     | 1.110.398  | 0,33                         |  |                          |         |                    |                              |
| US (GOVT) 4,625 % 28.02.26                     | 1.000.000                | USD     | 999.648    | 0,30                         |  |                          |         |                    |                              |
| US (GOVT) 4,625 % 15.09.26                     | 3.000.000                | USD     | 3.008.672  | 0,90                         |  |                          |         |                    |                              |
| US (GOVT) 4,625 % 15.11.26                     | 4.700.000                | USD     | 4.718.727  | 1,41                         |  |                          |         |                    |                              |
| US (GOVT) 4,625 % 30.09.28                     | 1.549.000                | USD     | 1.572.719  | 0,47                         |  |                          |         |                    |                              |
| US (GOVT) 4,625 % 30.09.30                     | 2.500.000                | USD     | 2.557.910  | 0,76                         |  |                          |         |                    |                              |
| US (GOVT) 4,75 % 15.11.2053                    | 2.308.000                | USD     | 2.471.363  | 0,74                         |  |                          |         |                    |                              |
| US (GOVT) 5 % 31.08.25                         | 1.800.000                | USD     | 1.804.148  | 0,54                         |  |                          |         |                    |                              |
| US (GOVT) 5 % 31.10.25                         | 1.900.000                | USD     | 1.906.234  | 0,57                         |  |                          |         |                    |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

US Dollar Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung                                    | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert   | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|------------------|------------------------------|--|--------------------------|---------|------------|------------------------------|
| CREDIT AGRICOLE 5,514 %<br>05/07/2033           | 1.095.000                | USD     | 1.122.118        | 0,34                         | BROADCOM 3,187 %<br>15.11.36                                 | 1.027.000                | USD     | 819.220    | 0,24                         |
| CREDIT AGRICOLE 6,316 %<br>VRN 03.10.29         | 800.000                  | USD     | 829.949          | 0,25                         | CENTENE 3 % 15.10.30   | 125.000                  | USD     | 107.282    | 0,03                         |
| SOCIETE GENERALE 5,634 %<br>VRN 19.01.30        | 2.815.000                | USD     | 2.806.553        | 0,84                         | CHARTER COMMUNICATIONS<br>OPERATING 5,125 % 01.07.49         | 1.250.000                | USD     | 972.020    | 0,29                         |
| SOCIETE GENERALE 6,691 %<br>VRN 10.01.34        | 200.000                  | USD     | 210.085          | 0,06                         | CITIGROUP 4,7 % VRN PERP<br>DAE FUNDING 1,55 %<br>01/08/2024 | 325.000                  | USD     | 318.256    | 0,10                         |
|   |                          |         | <b>8.851.247</b> | <b>2,65</b>                  | DELL INTERNATIONAL 4,9 %<br>01/10/2026                       | 1.425.000                | USD     | 1.417.276  | 0,42                         |
| <b>DEUTSCHLAND</b>                              |                          |         |                  |                              | DELL INTERNATIONAL<br>6,02 % 15.06.26                        | 82.000                   | USD     | 83.129     | 0,02                         |
| DEUTSCHE BANK 2,311 %<br>VRN 16.11.27           | 600.000                  | USD     | 548.761          | 0,16                         | ENERGY TRANSFER OPERATING<br>6,25 % 15.04.49                 | 390.000                  | USD     | 401.810    | 0,12                         |
|   |                          |         | <b>548.761</b>   | <b>0,16</b>                  | ENERGY TRANSFER PARTNERS<br>5,15 % 01.02.43                  | 500.000                  | USD     | 449.704    | 0,13                         |
| <b>GROSSBRITANNIEN</b>                          |                          |         |                  |                              | ENERGY TRANSFER PARTNERS<br>6 % 15.06.48                     | 200.000                  | USD     | 199.766    | 0,06                         |
| MACQUARIE AIRFINANCE<br>HOLDINGS 6,4 % 26.03.29 | 290.000                  | USD     | 294.743          | 0,09                         | EPR PROPERTIES 3,6 %<br>15.11.31                             | 775.000                  | USD     | 649.225    | 0,19                         |
|   |                          |         | <b>294.743</b>   | <b>0,09</b>                  | FORD MOTOR CREDIT 6,05 %<br>05/03/2031                       | 1.415.000                | USD     | 1.428.078  | 0,43                         |
| <b>IRLAND</b>                                   |                          |         |                  |                              | GLP CAPITAL<br>6,75 % 01.12.33                               | 650.000                  | USD     | 685.685    | 0,21                         |
| AIB GROUP 6,608 % VRN<br>13.09.29               | 625.000                  | USD     | 652.026          | 0,19                         | JACKSON FINANCIAL<br>3,125 % 23.11.31                        | 235.000                  | USD     | 196.361    | 0,06                         |
| AVOLON HOLDINGS FUNDING<br>2,125 % 21.02.26     | 305.000                  | USD     | 284.503          | 0,09                         | JPMORGAN CHASE 5 % VRN<br>PERP                               | 775.000                  | USD     | 773.791    | 0,23                         |
| AVOLON HOLDINGS FUNDING<br>3,95 % 01.07.24      | 755.000                  | USD     | 750.827          | 0,22                         | KENNAMETAL 2,8 %<br>01/03/2031                               | 260.000                  | USD     | 220.966    | 0,07                         |
|   |                          |         | <b>1.687.356</b> | <b>0,50</b>                  | KENNAMETAL 4,625 %<br>15.06.28                               | 310.000                  | USD     | 305.048    | 0,09                         |
| <b>ITALIEN</b>                                  |                          |         |                  |                              | MERCEDESBEZ FINANCE NORTH<br>AMERICA 5 % 11.01.34            | 1.540.000                | USD     | 1.528.348  | 0,46                         |
| INTESA SANPAOLO 4,198 %<br>01/06/2032           | 290.000                  | USD     | 243.086          | 0,07                         | MERCEDESBEZ FINANCE NORTH<br>AMERICA 5,1 % 08.03.28          | 1.015.000                | USD     | 1.020.496  | 0,31                         |
| INTESA SANPAOLO 6,625 %<br>20.06.33             | 740.000                  | USD     | 770.118          | 0,23                         | SABRA HEALTH CARE 3,9 %<br>15.10.29                          | 565.000                  | USD     | 510.215    | 0,15                         |
| INTESA SANPAOLO 7,2 %<br>28.11.33               | 620.000                  | USD     | 670.462          | 0,20                         | SANTANDER HOLDINGS 3,5 %<br>07/06/2024                       | 1.475.000                | USD     | 1.468.278  | 0,44                         |
|   |                          |         | <b>1.683.666</b> | <b>0,50</b>                  | SYNCHRONY FINANCIAL<br>2,875 % 28.10.31                      | 447.000                  | USD     | 358.017    | 0,11                         |
| <b>USA</b>                                      |                          |         |                  |                              | UNION PACIFIC 5,082 %<br>02/01/2029                          | 500.000                  | USD     | 26.701     | 0,01                         |
| ABBVIE 5,4 % 15.03.54                           | 1.240.000                | USD     | 1.279.142        | 0,38                         | US (GOVT) 3,25 % 15.05.42                                    | 7.050.000                | USD     | 6.011.777  | 1,80                         |
| AIRCATTLE 5,25 % 11.08.25                       | 2.025.000                | USD     | 2.007.263        | 0,60                         | US (GOVT) 3,375 % 15.08.42                                   | 2.175.000                | USD     | 1.884.434  | 0,56                         |
| AVIATION CAPITAL GROUP<br>1,95 % 30.01.26       | 360.000                  | USD     | 336.349          | 0,10                         | US (GOVT) 3,625 % 31.05.28                                   | 10.800.000               | USD     | 10.535.905 | 3,15                         |
| AVIATION CAPITAL GROUP<br>1,95 % 20.09.26       | 740.000                  | USD     | 676.820          | 0,20                         | US (GOVT) 4 % 15.02.34                                       | 5.522.000                | USD     | 5.439.601  | 1,63                         |
| AVIATION CAPITAL GROUP<br>6,375 % 15.07.30      | 955.000                  | USD     | 984.449          | 0,29                         |  |                          |         |            |                              |
| BANK OF AMERICA 2,482 %<br>VRN 21.09.36         | 1.050.000                | USD     | 840.084          | 0,25                         |  |                          |         |            |                              |
| BOARDWALK PIPELINES<br>3,4 % 15.02.31           | 620.000                  | USD     | 551.453          | 0,16                         |  |                          |         |            |                              |
| BRISTOLMYERS SQUIBB<br>5,2 % 22.02.34           | 790.000                  | USD     | 803.875          | 0,24                         |  |                          |         |            |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

US Dollar Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung                           | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert            | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--------------------------|---------|--------------------|------------------------------|--|--------------------------|---------|---------------------|------------------------------|
| US (GOVT) 4,25 % 28.02.29<br>WARNERMEDIA HOLDINGS  | 17.910.000               | USD     | 17.951.276         | 5,37                         |  |                          |         |                     |                              |
| 5,05 % 15.03.42<br>WASTE MANAGEMENT 4,15 %<br>15.04.32                                   | 370.000<br>510.000       | USD     | 318.207<br>488.451 | 0,10<br>0,15                 | <b>GELDMARKTINSTRUMENTE</b>            |                          |         |                     |                              |
|  |                          |         | <b>64.507.030</b>  | <b>19,29</b>                 | <b>SCHATZWECHSEL</b>                   |                          |         |                     |                              |
| <b>SUMME ANLEIHEN</b>  |                          |         | <b>81.804.633</b>  | <b>24,46</b>                 | <b>USA</b>                             |                          |         |                     |                              |
| <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>  |                          |         |                    |                              | US (GOVT) 0 % 02.05.24                 | 60.600.000               | USD     | 60.324.864          | 18,04                        |
| <b>USA</b>   |                          |         |                    |                              |  |                          |         | <b>60.324.864</b>   | <b>18,04</b>                 |
| ASSET BACKED FUNDING   |                          |         |                    |                              | <b>SUMME SCHATZWECHSEL</b>             |                          |         | <b>60.324.864</b>   | <b>18,04</b>                 |
| 4,18 % 25.03.33  | 2.425.000                | USD     | 34.755             | 0,01                         | <b>GELDMARKTINSTRUMENTE GESAMT</b>     |                          |         | <b>60.324.864</b>   | <b>18,04</b>                 |
| FNMA 1,50 % TBA 15.04.2036   | 5.140.000                | USD     | 4.457.747          | 1,33                         | <b>SUMME WERTPAPIERANLAGEN</b>         |                          |         | <b>433.579.588</b>  | <b>129,64</b>                |
| FNMA 1,50 % TBA 15.04.51   | 5.440.000                | USD     | 4.104.910          | 1,23                         | <b>SONSTIGE NETTOVERBINDLICHKEITEN</b> |                          |         | <b>(99.128.276)</b> | <b>(29,64)</b>               |
| FNMA 2,50 % TBA 15.04.2036   | 6.230.000                | USD     | 5.672.071          | 1,70                         | <b>GESAMTNETTOVERMÖGEN</b>             |                          |         | <b>334.451.312</b>  | <b>100,00</b>                |
| FNMA 3,00 % TBA 15.04.51   | 7.860.000                | USD     | 6.781.419          | 2,02                         |  |                          |         |                     |                              |
| FNMA 3,50 % TBA 15.04.51   | 5.210.000                | USD     | 4.672.146          | 1,40                         |  |                          |         |                     |                              |
| FNMA 4,00 % TBA 15.04.51   | 3.700.000                | USD     | 3.434.351          | 1,03                         |  |                          |         |                     |                              |
| FNMA 4,50 % TBA 15.04.51   | 1.390.000                | USD     | 1.325.807          | 0,40                         |  |                          |         |                     |                              |
| FNMA 5,00 % TBA 15.04.35   | 1.760.000                | USD     | 1.720.685          | 0,51                         |  |                          |         |                     |                              |
| FNMA 5,00 % TBA 15.04.2036   | 6.780.000                | USD     | 6.755.214          | 2,01                         |  |                          |         |                     |                              |
| FNMA 6,00 % TBA 15.04.35   | 3.860.000                | USD     | 3.899.681          | 1,17                         |  |                          |         |                     |                              |
| FNMA 6,50 % TBA 15.04.35   | 4.740.000                | USD     | 4.845.858          | 1,45                         |  |                          |         |                     |                              |
| GINNIE MAE 2,00 % TBA<br>15.04.2051  | 6.280.000                | USD     | 5.155.786          | 1,54                         |  |                          |         |                     |                              |
| GNMA 3,00 % TBA 15.04.2051   | 4.490.000                | USD     | 3.969.277          | 1,19                         |  |                          |         |                     |                              |
| GNMA 3,50 % TBA 15.04.2051   | 5.440.000                | USD     | 4.961.704          | 1,48                         |  |                          |         |                     |                              |
| GNMA 4,00 % TBA 15.04.2051   | 3.920.000                | USD     | 3.677.756          | 1,10                         |  |                          |         |                     |                              |
| GNMA 4,50 % TBA 15.04.49   | 750.000                  | USD     | 721.435            | 0,22                         |  |                          |         |                     |                              |
| GNMA 5,50 % TBA 15.04.54   | 2.350.000                | USD     | 2.350.059          | 0,70                         |  |                          |         |                     |                              |
|  |                          |         | <b>68.540.661</b>  | <b>20,49</b>                 |  |                          |         |                     |                              |
| <b>SUMME FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>  |                          |         | <b>68.540.661</b>  | <b>20,49</b>                 |  |                          |         |                     |                              |
| <b>SUMME DER AN EINER GEREGELTEN<br/>MARKT GEHANDELTEN ÜBERTRAGBAREN<br/>WERTPAPIERE</b> |                          |         | <b>150.345.294</b> | <b>44,95</b>                 |  |                          |         |                     |                              |
| <b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>   |                          |         |                    |                              |  |                          |         |                     |                              |
| <b>IRLAND</b>  |                          |         |                    |                              |  |                          |         |                     |                              |
| HSBC GLOBAL LIQUIDITY<br>FUND  | 4.312.752                | USD     | 4.312.752          | 1,29                         |  |                          |         |                     |                              |
|  |                          |         | <b>4.312.752</b>   | <b>1,29</b>                  |  |                          |         |                     |                              |
| <b>LUXEMBURG</b>   |                          |         |                    |                              |  |                          |         |                     |                              |
| HGIF ASIA HY BOND „ZC“*  | -                        | USD     | -                  | 0,00                         |  |                          |         |                     |                              |
| HGIF GLOBAL ASSET<br>BACKED BOND „Z“   | 37.567                   | USD     | 6.462.464          | 1,93                         |  |                          |         |                     |                              |
|  |                          |         | <b>6.462.464</b>   | <b>1,93</b>                  |  |                          |         |                     |                              |
| <b>SUMME ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>   |                          |         | <b>10.775.216</b>  | <b>3,22</b>                  |  |                          |         |                     |                              |

\*Die im Anlagenportfolio gehaltene Anzahl beträgt 0,01 Anteile.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

US High Yield Bond

Aufstellung der Wertpapiervermögens zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert       | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|----------------|------------------------------|--|--------------------------|---------|----------|------------------------------|
| <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>  |                          |         |                |                              | <b>FORD MOTOR COMPANY</b>  |                          |         |          |                              |
| <b>AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |                          |         |                |                              | 6,625 % 01.10.28   |                          |         |          |                              |
| <b>ANLEIHEN</b>   |                          |         |                |                              | 121.000 USD 127.225 0,29   |                          |         |          |                              |
| <b>KANADA</b>   |                          |         |                |                              | GENESIS ENERGY 8,875 %   |                          |         |          |                              |
| BOMBARDIER 7,125 %  |                          |         |                |                              | 15.04.30   | 124.000                  | USD     | 130.010  | 0,30                         |
| 15.06.26  | 97.000                   | USD     | 98.559         | 0,23                         | GOODYEAR TIRE RUBBER   |                          |         |          |                              |
| BOMBARDIER 7,875 %  |                          |         |                |                              | 5 % 15.07.29   |                          |         |          |                              |
| 15.04.27  | 109.000                  | USD     | 109.240        | 0,25                         | 164.000 USD 153.181 0,35   |                          |         |          |                              |
| NOVA CHEMICALS 8,5 %  |                          |         |                |                              | ONEMAIN FINANCE 7,875 %  |                          |         |          |                              |
| 15.11.28  | 59.000                   | USD     | 62.887         | 0,15                         | 15.03.30   |                          |         |          |                              |
|   |                          |         | <b>270.686</b> | <b>0,63</b>                  | 100.000 USD 103.494 0,24   |                          |         |          |                              |
| <b>CHINA</b>  |                          |         |                |                              | ONEMAIN FINANCE 9 %  |                          |         |          |                              |
| WYNN MACAU 5,5 %  |                          |         |                |                              | 15.01.29   |                          |         |          |                              |
| 01/10/2027  | 200.000                  | USD     | 191.557        | 0,44                         | 84.000 USD 89.207 0,21   |                          |         |          |                              |
|   |                          |         | <b>191.557</b> | <b>0,44</b>                  | SPRINGLEAF FINANCE   |                          |         |          |                              |
| <b>GROSSBRITANNIEN</b>  |                          |         |                |                              | 5,375 % 15.11.29   |                          |         |          |                              |
| BARCLAYS 8 % VRN PERP   | 200.000                  | USD     | 200.008        | 0,46                         | 73.000 USD 68.719 0,16   |                          |         |          |                              |
| INEOS QUATTRO FINANCE   |                          |         |                |                              | SPRINT CAPITAL 6,875 %   |                          |         |          |                              |
| 9,625 % 15.03.29  | 200.000                  | USD     | 215.443        | 0,50                         | 15.11.28   |                          |         |          |                              |
| LLOYDS BANKING GROUP  |                          |         |                |                              | 350.000 USD 372.568 0,86   |                          |         |          |                              |
| 7,5 % VRN PERP  | 200.000                  | USD     | 199.196        | 0,46                         | UNITED RENTALS NORTH   |                          |         |          |                              |
|   |                          |         | <b>614.647</b> | <b>1,42</b>                  | AMERICA 4 % 15.07.30   |                          |         |          |                              |
| <b>IRLAND</b>   |                          |         |                |                              | US (GOVT) 4,75 %   |                          |         |          |                              |
| VIRGIN MEDIA VENDOR FINANCING                                     |                          |         |                |                              | 15.11.43   |                          |         |          |                              |
| NOTES 5 % 15.07.28  | 300.000                  | USD     | 275.588        | 0,64                         | 85.000 USD 88.433 0,20   |                          |         |          |                              |
|   |                          |         | <b>275.588</b> | <b>0,64</b>                  | <b>SUMME ANLEIHEN</b>  |                          |         |          |                              |
| <b>ITALIEN</b>  |                          |         |                |                              | <b>2.388.676</b>   |                          |         |          |                              |
| UNICREDIT 8 % VRN PERP  | 200.000                  | USD     | 200.379        | 0,46                         | <b>4.287.662</b>   |                          |         |          |                              |
|   |                          |         | <b>200.379</b> | <b>0,46</b>                  | <b>9,92</b>  |                          |         |          |                              |
| <b>NIEDERLANDE</b>  |                          |         |                |                              | <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTEN WERTPAPIERE</b>              |                          |         |          |                              |
| AERCAP HOLDINGS 5,875 %   |                          |         |                |                              | <b>4.287.662</b>   |                          |         |          |                              |
| VRN 10.10.79  | 150.000                  | USD     | 149.202        | 0,35                         | <b>9,92</b>  |                          |         |          |                              |
| TRIVIUM PACKAGING   |                          |         |                |                              | <b>AN EINEM ANDEREM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE, ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |                          |         |          |                              |
| FINANCE 5,5 % 15.08.2026  | 200.000                  | USD     | 196.927        | 0,46                         | <b>ANLEIHEN</b>  |                          |         |          |                              |
|   |                          |         | <b>346.129</b> | <b>0,81</b>                  | <b>AUSTRALIEN</b>  |                          |         |          |                              |
| <b>USA</b>  |                          |         |                |                              | FMG RESOURCES 5,875 %  |                          |         |          |                              |
| ALBERTSONS SAFEWAY  |                          |         |                |                              | 15.04.30   |                          |         |          |                              |
| 4,875 % 15.02.30  | 73.000                   | USD     | 69.537         | 0,16                         | 125.000 USD 122.993 0,28   |                          |         |          |                              |
| ALBERTSONS SAFEWAY 6,5 %  |                          |         |                |                              | FMG RESOURCES 6,125 %  |                          |         |          |                              |
| 15.02.28  | 165.000                  | USD     | 167.019        | 0,39                         | 15.04.32   |                          |         |          |                              |
| AMERICAN AXLE MANUFACTURING                                       |                          |         |                |                              | 91.000 USD 90.111 0,21   |                          |         |          |                              |
| 5 % 01.10.29  | 250.000                  | USD     | 225.238        | 0,52                         | MINERAL RESOURCES 8 %  |                          |         |          |                              |
| ARSENAL AIC PARENT  |                          |         |                |                              | 01/11/2027   |                          |         |          |                              |
| 8 % 01.10.30  | 196.000                  | USD     | 206.729        | 0,48                         | 69.000 USD 70.435 0,16   |                          |         |          |                              |
| BALL CORP 6,875 %   |                          |         |                |                              | MINERAL RESOURCES  |                          |         |          |                              |
| 15.03.28  | 183.000                  | USD     | 188.225        | 0,44                         | 8,125 % 01.05.27   |                          |         |          |                              |
| EPR PROPERTIES 4,5 %  |                          |         |                |                              | 93.000 USD 94.141 0,22   |                          |         |          |                              |
| 01/06/2027  | 323.000                  | USD     | 308.018        | 0,71                         | MINERAL RESOURCES 8,5 %  |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                |                              | 01/05/2030   |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                |                              | 66.000 USD 68.142 0,16   |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                |                              | <b>445.822</b>   |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                |                              | <b>1,03</b>  |                          |         |          |                              |
| <b>KANADA</b>   |                          |         |                |                              | <b>BC ULC NEW RED FINANCE</b>  |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                |                              | 4,375 % 15.01.28   |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                |                              | 167.000 USD 158.026 0,37   |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                |                              | BOMBARDIER 7,25 %  |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                |                              | 01/07/2031   |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                |                              | 26.000 USD 26.121 0,06   |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                |                              | FIRST QUANTUM MINERALS   |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                |                              | 9,375 % 01.03.29   |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                |                              | 200.000 USD 207.417 0,48   |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                |                              | GFL ENVIRONMENTAL 4,75 %   |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                |                              | 15.06.29   |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                |                              | 272.000 USD 255.986 0,59   |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                |                              | GFL ENVIRONMENTAL 6,75 %   |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                |                              | 15.01.31   |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |                |                              | 98.000 USD 100.634 0,23  |                          |         |          |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

US High Yield Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung                                    | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung                                       | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|------------------|------------------------------|--|--------------------------|---------|----------|------------------------------|
| HUSKY INJECTION MOLDING<br>SYSTEMS 9 % 15.02.29 | 209.000                  | USD     | 216.412          | 0,50                         | ALLY FINANCIAL 4,7 % VRN<br>PERP                   | 305.000                  | USD     | 242.674  | 0,56                         |
| NOVA CHEMICALS 9 %<br>15.02.30                  | 174.000                  | USD     | 179.892          | 0,42                         | AMER SPORTS 6,75 %<br>16.02.31                     | 140.000                  | USD     | 139.752  | 0,32                         |
|   |                          |         | <b>1.144.488</b> | <b>2,65</b>                  | AMERICAN AIRLINES 8,5 %<br>15.05.29                | 127.000                  | USD     | 134.225  | 0,31                         |
| <b>FRANKREICH</b>                               |                          |         |                  |                              | AMERICAN AIRLINES ADVANTAGE<br>5,75 % 20.04.29     | 641.000                  | USD     | 631.336  | 1,45                         |
| ALTICE FRANCE 8,125 %<br>01/02/2027             | 293.000                  | USD     | 226.707          | 0,52                         | ANTERO MIDSTREAM PARTNERS<br>5,75 % 15.01.28       | 300.000                  | USD     | 295.786  | 0,68                         |
| ILIAD HOLDING SASU 6,5 %<br>15.10.26            | 347.000                  | USD     | 344.033          | 0,80                         | ANTERO MIDSTREAM PARTNERS<br>6,625 % 01.02.32      | 58.000                   | USD     | 58.374   | 0,14                         |
|   |                          |         | <b>570.740</b>   | <b>1,32</b>                  | ANTERO RESOURCES 5,375 %<br>01/03/2030             | 248.000                  | USD     | 238.493  | 0,55                         |
| <b>GROSSBRITANNIEN</b>                          |                          |         |                  |                              | ANTERO RESOURCES 7,625 %<br>01/02/2029             | 208.000                  | USD     | 214.189  | 0,50                         |
| MACQUARIE AIRFINANCE<br>HOLDINGS 6,5 % 26.03.31 | 200.000                  | USD     | 203.833          | 0,47                         | ARCHROCK PARTNERS 6,25 %<br>01/04/2028             | 183.000                  | USD     | 181.177  | 0,42                         |
|   |                          |         | <b>203.833</b>   | <b>0,47</b>                  | ARCHROCK PARTNERS<br>6,875 % 01.04.27              | 116.000                  | USD     | 116.506  | 0,27                         |
| <b>IRLAND</b>                                   |                          |         |                  |                              | ARDAGH PACKAGING<br>FINANCE 4,125 % 15.08.2026     | 200.000                  | USD     | 181.730  | 0,42                         |
| ARDAGH PACKAGING<br>FINANCE 5,25 % 15.08.27     | 334.000                  | USD     | 211.416          | 0,49                         | ARSENAL AIC PARENT<br>11,5 % 01.10.31              | 152.000                  | USD     | 169.791  | 0,39                         |
|   |                          |         | <b>211.416</b>   | <b>0,49</b>                  | ASCENT RESOURCES UTICA<br>HOLDINGS 8,25 % 31.12.28 | 210.000                  | USD     | 215.899  | 0,50                         |
| <b>JERSEY</b>                                   |                          |         |                  |                              | ASHTON WOODS ASHTON<br>6,625 % 15.01.28            | 303.000                  | USD     | 304.389  | 0,70                         |
| ADIANT GLOBAL HOLDINGS<br>7 % 15.04.28          | 60.000                   | USD     | 61.421           | 0,14                         | AVIS BUDGET CAR RENTAL<br>8 % 15.02.31             | 174.000                  | USD     | 173.833  | 0,40                         |
| ADIANT GLOBAL HOLDINGS<br>8,25 % 15.04.31       | 132.000                  | USD     | 139.453          | 0,32                         | BLUE RACER MIDSTREAM<br>FINANCE 6,625 % 15.07.26   | 237.000                  | USD     | 236.881  | 0,55                         |
|   |                          |         | <b>200.874</b>   | <b>0,46</b>                  | BLUE RACER MIDSTREAM<br>7,625 % 15.12.25           | 183.000                  | USD     | 184.926  | 0,43                         |
| <b>LIBERIA</b>                                  |                          |         |                  |                              | BUCKEYE PARTNERS 4,5 %<br>01/03/2028               | 350.000                  | USD     | 332.809  | 0,77                         |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES<br>6,25 % 15.03.32      | 41.000                   | USD     | 41.384           | 0,10                         | BUCKEYE PARTNERS 5,85 %<br>15.11.43                | 174.000                  | USD     | 147.989  | 0,34                         |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES<br>8,25 % 15.01.29      | 250.000                  | USD     | 264.931          | 0,61                         | BUILDERS FIRSTSOURCE<br>6,375 % 01.03.34           | 244.000                  | USD     | 245.079  | 0,57                         |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES<br>9,25 % 15.01.29      | 370.000                  | USD     | 397.074          | 0,92                         | CAESARS ENTERTAINMENT<br>6,5 % 15.02.32            | 36.000                   | USD     | 36.375   | 0,08                         |
|   |                          |         | <b>703.389</b>   | <b>1,63</b>                  | CAESARS ENTERTAINMENT<br>7 % 15.02.30              | 121.000                  | USD     | 124.328  | 0,29                         |
| <b>NIEDERLANDE</b>                              |                          |         |                  |                              | CALLON PETROLEUM 7,5 %<br>15.06.30                 | 180.000                  | USD     | 190.874  | 0,44                         |
| ALCOA NEDERLAND HOLDING<br>7,125 % 15.03.31     | 157.000                  | USD     | 160.079          | 0,37                         | CALLON PETROLEUM 8 %<br>01/08/2028                 | 121.000                  | USD     | 126.605  | 0,29                         |
| ZIGGO BOND 5,125 %<br>28.02.30                  | 400.000                  | USD     | 342.647          | 0,79                         | CALPINE 5 % 01.02.31                               | 137.000                  | USD     | 125.600  | 0,29                         |
|   |                          |         | <b>502.726</b>   | <b>1,16</b>                  | CALPINE 5,125 % 15.03.2028                         | 350.000                  | USD     | 336.380  | 0,78                         |
| <b>PANAMA</b>                                   |                          |         |                  |                              | CAMELOT RETURN MERGER<br>8,75 % 01.08.28           | 229.000                  | USD     | 235.279  | 0,54                         |
| CARNIVAL 6 % 01.05.2029                         | 40.000                   | USD     | 39.554           | 0,09                         |  |                          |         |          |                              |
| CARNIVAL 7 % 15.08.29                           | 40.000                   | USD     | 41.804           | 0,10                         |  |                          |         |          |                              |
|   |                          |         | <b>81.358</b>    | <b>0,19</b>                  |  |                          |         |          |                              |
| <b>SPANIEN</b>                                  |                          |         |                  |                              |  |                          |         |          |                              |
| GRIFOLS ESCROW ISSUER<br>4,75 % 15.10.28        | 200.000                  | USD     | 165.633          | 0,38                         |  |                          |         |          |                              |
|   |                          |         | <b>165.633</b>   | <b>0,38</b>                  |  |                          |         |          |                              |
| <b>USA</b>                                      |                          |         |                  |                              |  |                          |         |          |                              |
| AAR ESCROW ISSUER 6,75 %<br>15.03.29            | 63.000                   | USD     | 63.603           | 0,15                         |  |                          |         |          |                              |
| ADAPTHEALTH 4,625 %<br>01/08/2029               | 220.000                  | USD     | 189.466          | 0,44                         |  |                          |         |          |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



## Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

US High Yield Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapiieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|----------|------------------------------|---|--------------------------|---------|----------|------------------------------|
| CARNIVAL HOLDINGS BERMUDA<br>10,375 % 01.05.28      | 476.000                  | USD     | 519.744  | 1,20                         | DIRECTV HOLDINGS 5,875 %<br>15.08.27                | 100.000                  | USD     | 94.696   | 0,22                         |
| CCO HOLDINGS 4,5 %<br>15.08.30                      | 192.000                  | USD     | 161.623  | 0,37                         | DISH NETWORK 11,75 %<br>15.11.27                    | 154.000                  | USD     | 157.431  | 0,36                         |
| CCO HOLDINGS 4,75 %<br>01/03/2030                   | 562.000                  | USD     | 483.725  | 1,12                         | EMERALD DEBT MERGER<br>6,625 % 15.12.30             | 215.000                  | USD     | 217.496  | 0,50                         |
| CCO HOLDINGS 5,375 %<br>01/06/2029                  | 147.000                  | USD     | 134.621  | 0,31                         | ENLINK MIDSTREAM 5,375 %<br>01/06/2029              | 223.000                  | USD     | 219.026  | 0,51                         |
| CCO HOLDINGS 5,5 %<br>01/05/2026                    | 360.000                  | USD     | 355.467  | 0,82                         | ENLINK MIDSTREAM 6,5 %<br>01/09/2030                | 163.000                  | USD     | 167.735  | 0,39                         |
| CENTRAL PARENT 7,25 %<br>15.06.29                   | 264.000                  | USD     | 269.876  | 0,62                         | EQM MIDSTREAM PARTNERS<br>7,5 % 01.06.27            | 225.000                  | USD     | 231.359  | 0,54                         |
| CHART INDUSTRIES 7,5 %<br>01/01/2030                | 157.000                  | USD     | 163.198  | 0,38                         | EQM MIDSTREAM PARTNERS<br>7,5 % 01.06.30            | 148.000                  | USD     | 158.426  | 0,37                         |
| CHART INDUSTRIES 9,5 %<br>01/01/2031                | 84.000                   | USD     | 91.679   | 0,21                         | ESAB 6,25 % 15.04.29                                | 74.000                   | USD     | 74.452   | 0,17                         |
| CHENIERE ENERGY<br>PARTNERS 3,25 % 31.01.32         | 5.000                    | USD     | 4.263    | 0,01                         | FERTITTA ENTERTAINMENT<br>6,75 % 15.07.30           | 128.000                  | USD     | 115.366  | 0,27                         |
| CHSCOMMUNITY HEALTH<br>SYSTEMS 5,25 % 15.05.30      | 45.000                   | USD     | 36.739   | 0,08                         | FORTREA HOLDINGS 7,5 %<br>01/07/2030                | 194.000                  | USD     | 200.587  | 0,46                         |
| CHSCOMMUNITY HEALTH<br>SYSTEMS 6,875 % 01.04.28     | 285.000                  | USD     | 201.772  | 0,47                         | FREEDOM MORTGAGE<br>HOLDINGS 9,25 % 01.02.29        | 51.000                   | USD     | 52.248   | 0,12                         |
| CHSCOMMUNITY HEALTH<br>SYSTEMS 8 % 15.03.2026       | 155.000                  | USD     | 154.647  | 0,36                         | FRONTIER COMMUNICATIONS<br>5,875 % 15.10.27         | 320.000                  | USD     | 310.180  | 0,72                         |
| CINEMARK 5,875 %<br>15.03.26                        | 213.000                  | USD     | 210.633  | 0,49                         | GEN DIGITAL 7,125 %<br>30.09.30                     | 254.000                  | USD     | 261.135  | 0,60                         |
| CIVITAS RESOURCES<br>8,375 % 01.07.28               | 193.000                  | USD     | 203.836  | 0,47                         | GENERAL MOTORS<br>FINANCIAL 6,5 % VRN PERP          | 250.000                  | USD     | 242.111  | 0,56                         |
| CIVITAS RESOURCES<br>8,625 % 01.11.30               | 35.000                   | USD     | 37.601   | 0,09                         | GENESIS ENERGY LP GENESIS<br>ENERGY 7,75 % 01.02.28 | 113.000                  | USD     | 113.745  | 0,26                         |
| CIVITAS RESOURCES 8,75 %<br>01/07/2031              | 145.000                  | USD     | 155.516  | 0,36                         | GLP CAPITAL 5,75 %<br>01/06/2028                    | 129.000                  | USD     | 129.378  | 0,30                         |
| CLEVELANDCLIFFS 5,875 %<br>01/06/2027               | 251.000                  | USD     | 251.216  | 0,58                         | GLP CAPITAL LP GLP<br>FINANCING 6,75 % 01.12.33     | 65.000                   | USD     | 68.568   | 0,16                         |
| CLEVELANDCLIFFS 6,75 %<br>15.04.30                  | 236.000                  | USD     | 237.331  | 0,55                         | GPC MERGER 7,125 %<br>15.08.28                      | 404.000                  | USD     | 366.968  | 0,85                         |
| CLEVELANDCLIFFS 7 %<br>15.03.32                     | 76.000                   | USD     | 77.097   | 0,18                         | GRAY ESCROW 7 %<br>15.05.27                         | 105.000                  | USD     | 97.838   | 0,23                         |
| CLOUD SOFTWARE 6,5 %<br>31.03.29                    | 247.000                  | USD     | 234.544  | 0,54                         | HILTON GRAND VACATIONS BORROWER<br>6,625 % 15.01.32 | 108.000                  | USD     | 108.413  | 0,25                         |
| CLYDESDALE ACQUISITION<br>HOLDINGS 6,625 % 15.04.29 | 114.000                  | USD     | 114.245  | 0,26                         | HOME POINT CAPITAL 5 %<br>01/02/2026                | 193.000                  | USD     | 189.095  | 0,44                         |
| CLYDESDALE ACQUISITION<br>HOLDINGS 8,75 % 15.04.30  | 290.000                  | USD     | 285.336  | 0,66                         | IQVIA 6,5 % 15.05.30                                | 200.000                  | USD     | 204.298  | 0,47                         |
| COLGATE ENERGY PARTNERS<br>5,875 % 01.07.29         | 382.000                  | USD     | 375.963  | 0,87                         | IRON MOUNTAIN 5,25 %<br>15.07.30                    | 379.000                  | USD     | 359.476  | 0,83                         |
| CORNERSTONE BUILDING<br>BRANDS 6,125 % 15.01.29     | 138.000                  | USD     | 123.590  | 0,29                         | JEFFERIES FINANCE 5 %<br>15.08.28                   | 342.000                  | USD     | 314.962  | 0,73                         |
| CSC HOLDINGS 11,25 %<br>15.05.28                    | 438.000                  | USD     | 434.574  | 1,01                         | JELD WEN 4,875 %<br>15.12.27                        | 248.000                  | USD     | 237.901  | 0,55                         |
| DAVE BUSTERS 7,625 %<br>01/11/2025                  | 394.000                  | USD     | 397.320  | 0,92                         | KINETIK HOLDINGS 5,875 %<br>15.06.30                | 353.000                  | USD     | 345.659  | 0,80                         |
|   |                          |         |          |                              | KODIAK GAS SERVICES<br>7,25 % 15.02.29              | 234.000                  | USD     | 238.667  | 0,55                         |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

US High Yield Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung                                      | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung                                    | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|----------|------------------------------|---|--------------------------|---------|----------|------------------------------|
| LABL 9,5 % 01.11.28                               | 343.000                  | USD     | 347.776  | 0,80                         | PRIME SECURITY SERVICES BORROWER                |                          |         |          |                              |
| LEVEL 3 FINANCING 10,5 %<br>15.05.30              | 242.000                  | USD     | 250.151  | 0,58                         | 6,25 % 15.01.28                                 | 106.000                  | USD     | 103.972  | 0,24                         |
| LIFEPOINT HEALTH 9,875 %<br>15.08.30              | 225.000                  | USD     | 235.577  | 0,54                         | RITHM CAPITAL 6,25 %<br>15.10.25                | 97.000                   | USD     | 96.367   | 0,22                         |
| MACYS RETAIL HOLDINGS<br>5,875 % 01.04.29         | 359.000                  | USD     | 352.597  | 0,82                         | RITHM CAPITAL 8 %<br>01/04/2029                 | 213.000                  | USD     | 206.797  | 0,48                         |
| MCAFFEE 7,375 % 15.02.30                          | 210.000                  | USD     | 193.920  | 0,45                         | SEAGATE 8,25 % 15.12.29                         | 170.000                  | USD     | 183.028  | 0,42                         |
| MEDLINE BORROWER<br>LPMEDLINE 6,25 % 01.04.2029   | 151.000                  | USD     | 151.866  | 0,35                         | SEALED AIR 6,125 %<br>01/02/2028                | 94.000                   | USD     | 94.345   | 0,22                         |
| MGM RESORTS INTERNATIONAL<br>6,5 % 15.04.32       | 206.000                  | USD     | 205.808  | 0,48                         | SERVICE PROPERTIES<br>TRUST 5,5 % 15.12.27      | 143.000                  | USD     | 136.039  | 0,31                         |
| MODIVCARE ESCROW ISSUER<br>5 % 01.10.29           | 254.000                  | USD     | 184.472  | 0,43                         | SERVICE PROPERTIES<br>TRUST 7,5 % 15.09.25      | 160.000                  | USD     | 162.177  | 0,38                         |
| MOZART DEBT MERGER<br>3,875 % 01.04.29            | 258.000                  | USD     | 235.259  | 0,54                         | SERVICE PROPERTIES<br>TRUST 8,625 % 15.11.31    | 106.000                  | USD     | 113.165  | 0,26                         |
| MSCI 3,25 % 15.08.33                              | 75.000                   | USD     | 62.046   | 0,14                         | SIRIUS XM RADIO 5 %<br>01/08/2027               | 65.000                   | USD     | 62.679   | 0,14                         |
| NATIONSTAR MORTGAGE<br>HOLDINGS 5,5 % 15.08.28    | 235.000                  | USD     | 225.187  | 0,52                         | SIRIUS XM RADIO 5,5 %<br>01/07/2029             | 259.000                  | USD     | 247.474  | 0,57                         |
| NATIONSTAR MORTGAGE<br>HOLDINGS 5,75 % 15.11.31   | 170.000                  | USD     | 156.971  | 0,36                         | SPRINT 7,125 % 15.06.24                         | 246.000                  | USD     | 246.687  | 0,57                         |
| NATIONSTAR MORTGAGE<br>HOLDINGS 7,125 % 01.02.32  | 36.000                   | USD     | 35.837   | 0,08                         | STANDARD INDUSTRIES<br>4,75 % 15.01.28          | 225.000                  | USD     | 215.055  | 0,50                         |
| NAVIENT 6,75 % 15.06.2026                         | 534.000                  | USD     | 539.307  | 1,25                         | SUMMIT MATERIALS 7,25 %<br>15.01.31             | 32.000                   | USD     | 33.288   | 0,08                         |
| NCL 8,125 % 15.01.29                              | 192.000                  | USD     | 203.650  | 0,47                         | SUNOCO LP SUNOCO<br>FINANCE 7 % 15.09.28        | 102.000                  | USD     | 104.363  | 0,24                         |
| NCL 8,375 % 01.02.28                              | 74.000                   | USD     | 78.251   | 0,18                         | SURGERY CENTER HOLDINGS<br>7,25 % 15.04.32      | 150.000                  | USD     | 151.043  | 0,35                         |
| NCR 5 % 01.10.28                                  | 165.000                  | USD     | 154.040  | 0,36                         | TALLGRASS ENERGY<br>PARTNERS 5,5 % 15.01.28     | 165.000                  | USD     | 159.165  | 0,37                         |
| NCR 5,125 % 15.04.29                              | 17.000                   | USD     | 15.782   | 0,04                         | TALLGRASS ENERGY<br>PARTNERS 6 % 01.03.2027     | 48.000                   | USD     | 47.290   | 0,11                         |
| NCR ATLEOS ESCROW 9,5 %<br>01/04/2029             | 182.000                  | USD     | 194.787  | 0,45                         | TALLGRASS ENERGY<br>PARTNERS 6 % 31.12.30       | 50.000                   | USD     | 47.530   | 0,11                         |
| NOVELIS 4,75 % 30.01.2030                         | 102.000                  | USD     | 94.397   | 0,22                         | TALLGRASS ENERGY PARTNERS<br>7,375 % 15.02.29   | 128.000                  | USD     | 128.827  | 0,30                         |
| OPEN TEXT HOLDINGS<br>4,125 % 01.12.31            | 98.000                   | USD     | 86.016   | 0,20                         | TENET HEALTHCARE 6,125 %<br>01/10/2028          | 521.000                  | USD     | 520.083  | 1,20                         |
| OWENS MINOR 6,625 %<br>01/04/2030                 | 169.000                  | USD     | 167.926  | 0,39                         | TMOBILE USA 3,5 %<br>15.04.31                   | 137.000                  | USD     | 123.797  | 0,29                         |
| PACTIV EVERGREEN GROUP<br>ISSUER 4,375 % 15.10.28 | 240.000                  | USD     | 224.279  | 0,52                         | TRANSDIGM 5,5 % 15.11.2027                      | 44.000                   | USD     | 43.129   | 0,10                         |
| PANTHER BF AGGREGATOR<br>8,5 % 15.05.27           | 340.000                  | USD     | 340.708  | 0,79                         | TRANSDIGM 6,625 %<br>01/03/2032                 | 215.000                  | USD     | 217.334  | 0,50                         |
| PENNYMAC FINANCIAL<br>SERVICES 5,75 % 15.09.31    | 283.000                  | USD     | 263.152  | 0,61                         | TRANSDIGM 6,75 %<br>15.08.28                    | 322.000                  | USD     | 327.128  | 0,76                         |
| PENNYMAC FINANCIAL<br>SERVICES 7,875 % 15.12.29   | 168.000                  | USD     | 172.829  | 0,40                         | TRANSDIGM 7,125 %<br>01/12/2031                 | 41.000                   | USD     | 42.321   | 0,10                         |
| PERMIAN RESOURCES<br>OPERATING 7 % 15.01.32       | 220.000                  | USD     | 228.230  | 0,53                         | TRAVEL LEISURE 4,5 %<br>01/12/2029              | 54.000                   | USD     | 49.744   | 0,12                         |
| PETSMART FINANCE 7,75 %<br>15.02.29               | 500.000                  | USD     | 487.427  | 1,13                         | TRONOX 4,625 % 15.03.29                         | 267.000                  | USD     | 239.958  | 0,55                         |
| POST HOLDINGS 4,625 %<br>15.04.30                 | 328.000                  | USD     | 301.824  | 0,70                         | UNITED AIRLINES 4,625 %<br>15.04.29             | 275.000                  | USD     | 256.139  | 0,59                         |
| PRAIRIE ACQUIROR 9 %<br>01/08/2029                | 77.000                   | USD     | 79.533   | 0,18                         | UNITED RENTALS NORTH<br>AMERICA 5,25 % 15.01.30 | 385.000                  | USD     | 376.270  | 0,87                         |
| PRESIDIO HOLDINGS 8,25 %<br>01/02/2028            | 260.000                  | USD     | 259.844  | 0,60                         |   |                          |         |          |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

US High Yield Bond (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|
| VENTURE GLOBAL 8,125 %<br>01/06/2028  | 369.000                  | USD     | 377.249           | 0,87                         |
| VENTURE GLOBAL 9,875 %<br>01/02/2032  | 27.000                   | USD     | 29.143            | 0,07                         |
| VENTURE GLOBAL CALCASIEU<br>PASS 6,25 % 15.01.30                                    | 189.000                  | USD     | 190.363           | 0,44                         |
| VICI PROPERTIES 4,125 %<br>15.08.30   | 150.000                  | USD     | 136.850           | 0,32                         |
| VICI PROPERTIES 5,75 %<br>01/02/2027  | 180.000                  | USD     | 179.970           | 0,42                         |
| VIKING CRUISES 9,125 %<br>15.07.31  | 113.000                  | USD     | 123.791           | 0,29                         |
| VIKING OCEAN CRUISES<br>5,625 % 15.02.29  | 252.000                  | USD     | 245.853           | 0,57                         |
| VINE ENERGY HOLDINGS<br>6,75 % 15.04.29   | 372.000                  | USD     | 376.458           | 0,87                         |
| VISTRA 7 % VRN PERP   | 224.000                  | USD     | 222.024           | 0,51                         |
| VISTRA 8 % VRN PERP   | 120.000                  | USD     | 122.544           | 0,28                         |
| VISTRA OPERATIONS 5,5 %<br>01/09/2026   | 104.000                  | USD     | 102.512           | 0,24                         |
| WAND NEWCO 7,625 %<br>30.01.32  | 311.000                  | USD     | 322.119           | 0,75                         |
| WASH MULTIFAMILY ACQUISITION<br>5,75 % 15.04.26                                     | 215.000                  | USD     | 210.562           | 0,49                         |
| WR GRACE HOLDINGS<br>5,625 % 15.08.29   | 412.000                  | USD     | 369.217           | 0,85                         |
| WR GRACE HOLDINGS<br>7,375 % 01.03.31   | 70.000                   | USD     | 71.106            | 0,16                         |
| WYNDHAM DESTINATIONS<br>6,625 % 31.07.26  | 200.000                  | USD     | 201.641           | 0,47                         |
|   |                          |         | <b>31.413.765</b> | <b>72,66</b>                 |
| <b>SUMME ANLEIHEN</b>   |                          |         | <b>35.644.044</b> | <b>82,44</b>                 |
| <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN<br/>MARKT GEHANDELTEN ÜBERTRAGBAREN WERTPAPIERE</b> |                          |         | <b>35.644.044</b> | <b>82,44</b>                 |
| <b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>  |                          |         |                   |                              |
| <b>IRLAND</b>   |                          |         |                   |                              |
| HSBC GLOBAL LIQUIDITY<br>FUND   | 845.731                  | USD     | 845.731           | 1,96                         |
| ISHARES \$ HIGH YIELD<br>CORPORATE BOND ETF   | 9.900                    | USD     | 933.273           | 2,15                         |
|   |                          |         | <b>1.779.004</b>  | <b>4,11</b>                  |
| <b>SUMME ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>                                      |                          |         | <b>1.779.004</b>  | <b>4,11</b>                  |
| <b>SUMME WERTPAPIERANLAGEN</b>  |                          |         | <b>41.710.710</b> | <b>96,47</b>                 |
| <b>SONSTIGES NETTOVERMÖGEN</b>  |                          |         | <b>1.526.241</b>  | <b>3,53</b>                  |
| <b>GESAMTNETTOVERMÖGEN</b>  |                          |         | <b>43.236.951</b> | <b>100,00</b>                |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

US Short Duration High Yield Bond\*

Aufstellung der Wertpapiieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung                | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|------------------|------------------------------|-----------------------------|--------------------------|---------|------------------|------------------------------|
| <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>  |                          |         |                  |                              | <b>LLOYDS BANKING GROUP</b> |                          |         |                  |                              |
| <b>AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |                          |         |                  |                              | 7,5 % VRN PERP              |                          |         |                  |                              |
| <b>ANLEIHEN</b>   |                          |         |                  |                              | VODAFONE GROUP 2,625 %      |                          |         |                  |                              |
| <b>KANADA</b>   |                          |         |                  |                              | VRN 27.08.80                |                          |         |                  |                              |
| BOMBARDIER 7,125 %  |                          |         |                  |                              |                             | 786.000                  | USD     | 782.841          | 0,83                         |
| 15.06.26  | 602.000                  | USD     | 611.676          | 0,65                         |                             | 300.000                  | EUR     | 311.405          | 0,33                         |
| NOVA CHEMICALS 8,5 %  |                          |         |                  |                              |                             |                          |         | <b>1.857.275</b> | <b>1,98</b>                  |
| 15.11.28  | 123.000                  | USD     | 131.104          | 0,14                         |                             |                          |         |                  |                              |
|   |                          |         | <b>742.780</b>   | <b>0,79</b>                  | <b>IRLAND</b>               |                          |         |                  |                              |
| <b>FINNLAND</b>   |                          |         |                  |                              | ENERGIA GROUP ROI           |                          |         |                  |                              |
| HUHTAMAKI 4,25 %  |                          |         |                  |                              | FINANCECO 6,875 %           |                          |         |                  |                              |
| 09/06/2027  | 200.000                  | EUR     | 217.673          | 0,23                         | 31.07.28                    |                          |         |                  |                              |
|   |                          |         | <b>217.673</b>   | <b>0,23</b>                  | VIRGIN MEDIA VENDOR         |                          |         |                  |                              |
| <b>FRANKREICH</b>   |                          |         |                  |                              | FINANCING NOTES 5 %         |                          |         |                  |                              |
| CROWN EUROPEAN HOLDINGS   |                          |         |                  |                              | 15.07.28                    |                          |         |                  |                              |
| 5 % 15.05.28  | 150.000                  | EUR     | 166.652          | 0,18                         |                             | 450.000                  | USD     | 413.382          | 0,44                         |
| ERAMET 7 % 22.05.28   | 100.000                  | EUR     | 108.509          | 0,12                         |                             |                          |         | <b>749.723</b>   | <b>0,80</b>                  |
| LA BANQUE POSTALE   |                          |         |                  |                              | <b>ITALIEN</b>              |                          |         |                  |                              |
| 3,875 % VRN PERP  | 200.000                  | EUR     | 198.703          | 0,21                         | ATLANTIA 1,875 %            |                          |         |                  |                              |
| LA POSTE 3,125 % VRN PERP   | 200.000                  | EUR     | 210.253          | 0,22                         | 12/02/2028                  |                          |         |                  |                              |
| LOXAM 6,375 % 15.05.28  | 200.000                  | EUR     | 225.010          | 0,24                         | TELECOM ITALIA SPAMILANO    |                          |         |                  |                              |
| NEXANS 5,5 % 05.04.28   | 300.000                  | EUR     | 341.633          | 0,37                         | 7,875 % 31.07.28            |                          |         |                  |                              |
| PAPREC HOLDING 6,5 %  |                          |         |                  |                              | UNICREDIT 8 % VRN PERP      |                          |         |                  |                              |
| 17.11.27  | 500.000                  | EUR     | 568.333          | 0,61                         |                             | 450.000                  | EUR     | 534.513          | 0,57                         |
| RCI BANQUE 2,625 % VRN  |                          |         |                  |                              |                             | 345.000                  | USD     | 345.653          | 0,37                         |
| 18.02.30  | 200.000                  | EUR     | 211.395          | 0,23                         |                             |                          |         | <b>1.527.742</b> | <b>1,63</b>                  |
| RENAULT 2,375 % 25.05.26  | 600.000                  | EUR     | 626.201          | 0,67                         | <b>LUXEMBURG</b>            |                          |         |                  |                              |
| RENAULT 2,5 % 02.06.2027  | 300.000                  | EUR     | 310.110          | 0,33                         | STENA INTERNATIONAL         |                          |         |                  |                              |
| TEREOS FINANCE GROUPE   |                          |         |                  |                              | 7,25 % 15.02.28             |                          |         |                  |                              |
| 7,25 % 15.04.28   | 409.000                  | EUR     | 467.834          | 0,50                         |                             | 350.000                  | EUR     | 399.667          | 0,43                         |
|   |                          |         | <b>3.434.633</b> | <b>3,68</b>                  |                             |                          |         | <b>399.667</b>   | <b>0,43</b>                  |
| <b>DEUTSCHLAND</b>  |                          |         |                  |                              | <b>NIEDERLANDE</b>          |                          |         |                  |                              |
| DEUTSCHE BANK 5,625 %   |                          |         |                  |                              | AERCAP HOLDINGS 5,875 %     |                          |         |                  |                              |
| VRN 19.05.31  | 200.000                  | EUR     | 218.700          | 0,23                         | VRN 10.10.79                |                          |         |                  |                              |
| IHO VERWALTUNGS GMBH  |                          |         |                  |                              | DARLING GLOBAL FINANCE      |                          |         |                  |                              |
| 3,875 % 15.05.27  | 750.000                  | EUR     | 795.932          | 0,86                         | 3,625 % 15.05.26            |                          |         |                  |                              |
| NIDDA HEALTHCARE  |                          |         |                  |                              | OI EUROPEAN GROUP 6,25 %    |                          |         |                  |                              |
| HOLDING 7,5 % 21.08.2026  | 650.000                  | EUR     | 724.968          | 0,77                         | 15.05.28                    |                          |         |                  |                              |
| TUI 5,875 % 15.03.29  | 200.000                  | EUR     | 219.646          | 0,23                         | QPARK HOLDING 5,125 %       |                          |         |                  |                              |
| ZF FINANCE 3 % 21.09.2025   | 600.000                  | EUR     | 637.281          | 0,68                         | 01/03/2029                  |                          |         |                  |                              |
| ZF FINANCE 5,75 %   |                          |         |                  |                              | TELEFONICA EUROPE VRN       |                          |         |                  |                              |
| 03/08/2026  | 300.000                  | EUR     | 333.700          | 0,36                         | PERP                        |                          |         |                  |                              |
|   |                          |         | <b>2.930.227</b> | <b>3,13</b>                  | TRIVIUM PACKAGING           |                          |         |                  |                              |
| <b>GROSSBRITANNIEN</b>  |                          |         |                  |                              | FINANCE 5,5 % 15.08.2026    |                          |         |                  |                              |
| BARCLAYS 8 % VRN PERP   | 763.000                  | USD     | 763.029          | 0,82                         |                             | 879.000                  | USD     | 865.493          | 0,93                         |
|   |                          |         |                  |                              |                             |                          |         | <b>2.486.898</b> | <b>2,66</b>                  |
|   |                          |         |                  |                              | <b>PORTUGAL</b>             |                          |         |                  |                              |
|   |                          |         |                  |                              | EDP ENERGIAS DE PORTUGAL    |                          |         |                  |                              |
|   |                          |         |                  |                              | 1,7 % VRN 20.07.80          |                          |         |                  |                              |
|   |                          |         |                  |                              |                             | 300.000                  | EUR     | 312.443          | 0,33                         |
|   |                          |         |                  |                              |                             |                          |         | <b>312.443</b>   | <b>0,33</b>                  |
|   |                          |         |                  |                              | <b>RUMÄNIEN</b>             |                          |         |                  |                              |
|   |                          |         |                  |                              | RCS RDS 2,5 % 05.02.2025    |                          |         |                  |                              |
|   |                          |         |                  |                              |                             | 200.000                  | EUR     | 211.415          | 0,23                         |
|   |                          |         |                  |                              |                             |                          |         | <b>211.415</b>   | <b>0,23</b>                  |
|   |                          |         |                  |                              | <b>SPANIEN</b>              |                          |         |                  |                              |
|   |                          |         |                  |                              | BANCO DE SABADELL 6 %       |                          |         |                  |                              |
|   |                          |         |                  |                              | VRN 16.08.33                |                          |         |                  |                              |
|   |                          |         |                  |                              |                             | 200.000                  | EUR     | 223.334          | 0,24                         |
|   |                          |         |                  |                              |                             |                          |         | <b>223.334</b>   | <b>0,24</b>                  |

\* Bis zum 2. Juli 2023 lautete der Name des Teilfonds „Global Short Duration High Yield Bond“.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

US Short Duration High Yield Bond\* (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung                                    | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|---|--------------------------|---------|------------------|------------------------------|
| <b>SCHWEDEN</b>   |                          |         |                   |                              | <b>MOBILUX FINANCE 4,25 %</b>                   |                          |         |                  |                              |
| VERISURE HOLDING 3,875 %<br>15.07.26  | 600.000                  | EUR     | 639.701           | 0,68                         | 15.07.28  | 200.000                  | EUR     | 203.406          | 0,22                         |
| VERISURE MIDHOLDING<br>5,25 % 15.02.29  | 300.000                  | EUR     | 313.879           | 0,34                         | REXEL 2,125 % 15.06.28                          | 250.000                  | EUR     | 251.390          | 0,27                         |
|   |                          |         | <b>953.580</b>    | <b>1,02</b>                  | TEREOS FINANCE GROUPE<br>7,5 % 30.10.25         | 400.000                  | EUR     | 439.813          | 0,47                         |
| <b>USA</b>  |                          |         |                   |                              | <b>DEUTSCHLAND</b>                              |                          |         |                  |                              |
| EPR PROPERTIES 4,5 %<br>01/06/2027  | 1.000.000                | USD     | 953.616           | 1,02                         | WEPA HYGIENEPRODUKTE<br>2,875 % 15.12.27        | 350.000                  | EUR     | 355.105          | 0,38                         |
| FORD MOTOR CREDIT 3,25 %<br>15.09.25  | 600.000                  | EUR     | 641.147           | 0,69                         |   |                          |         | <b>355.105</b>   | <b>0,38</b>                  |
| FORD MOTOR CREDIT<br>4,867 % 03.08.27   | 200.000                  | EUR     | 222.655           | 0,24                         | <b>GROSSBRITANNIEN</b>                          |                          |         |                  |                              |
| FORD MOTOR CREDIT<br>6,125 % 15.05.28   | 100.000                  | EUR     | 116.595           | 0,12                         | DRAX FINCO 2,625 %<br>01/11/2025                | 400.000                  | EUR     | 420.339          | 0,45                         |
| IQVIA 2,25 % 15.01.28   | 300.000                  | EUR     | 301.668           | 0,32                         | EC FINANCE 3 % 15.10.2026                       | 689.000                  | EUR     | 724.361          | 0,77                         |
| OWENS MINOR 4,375 %<br>15.12.24   | 800.000                  | USD     | 793.678           | 0,85                         | MACQUARIE AIRFINANCE<br>HOLDINGS 6,4 % 26.03.29 | 60.000                   | USD     | 60.981           | 0,07                         |
| SILGAN HOLDINGS 2,25 %<br>01/06/2028  | 350.000                  | EUR     | 344.614           | 0,37                         |   |                          |         | <b>1.205.681</b> | <b>1,29</b>                  |
|   |                          |         | <b>3.373.973</b>  | <b>3,61</b>                  | <b>IRLAND</b>                                   |                          |         |                  |                              |
| <b>SUMME ANLEIHEN</b>   |                          |         | <b>19.421.363</b> | <b>20,76</b>                 | ARDAGH PACKAGING<br>FINANCE 2,125 % 15.08.2026  | 250.000                  | EUR     | 233.498          | 0,25                         |
| <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN<br/>BÖRSE NOTIERTEN WERTPAPIERE<br/>WERTPAPIERE</b> |                          |         | <b>19.421.363</b> | <b>20,76</b>                 | EIRCOM FINANCE 3,5 %<br>15.05.26                | 300.000                  | EUR     | 316.528          | 0,34                         |
| <b>AN EINEM ANDEREM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE, ÜBERTRAGBARE<br/>WERTPAPIERE</b>    |                          |         |                   |                              |   |                          |         | <b>550.026</b>   | <b>0,59</b>                  |
| <b>ANLEIHEN</b>   |                          |         |                   |                              | <b>ITALIEN</b>                                  |                          |         |                  |                              |
| <b>AUSTRALIEN</b>   |                          |         |                   |                              | NEXI 1,625 % 30.04.26                           | 500.000                  | EUR     | 513.624          | 0,55                         |
| FMG RESOURCES 4,5 %<br>15.09.27   | 400.000                  | USD     | 384.508           | 0,41                         |   |                          |         | <b>513.624</b>   | <b>0,55</b>                  |
| MINERAL RESOURCES<br>8,125 % 01.05.27   | 485.000                  | USD     | 490.949           | 0,53                         | <b>JERSEY</b>                                   |                          |         |                  |                              |
|   |                          |         | <b>875.457</b>    | <b>0,94</b>                  | ADIENT GLOBAL HOLDINGS<br>7 % 15.04.28          | 98.000                   | USD     | 100.321          | 0,11                         |
| <b>KANADA</b>   |                          |         |                   |                              | AVIS BUDGET FINANCE<br>4,75 % 30.01.26          | 300.000                  | EUR     | 324.162          | 0,34                         |
| GFL ENVIRONMENTAL 6,75 %<br>15.01.31  | 200.000                  | USD     | 205.375           | 0,22                         |   |                          |         | <b>424.483</b>   | <b>0,45</b>                  |
| HUBBAY MINERALS 4,5 %<br>01/04/2026   | 1.500.000                | USD     | 1.453.100         | 1,55                         | <b>LUXEMBURG</b>                                |                          |         |                  |                              |
| HUSKY INJECTION MOLDING<br>SYSTEMS 9 % 15.02.29                                     | 216.000                  | USD     | 223.661           | 0,24                         | DANA FINANCING LUXEMBOURG<br>5,75 % 15.04.25    | 502.000                  | USD     | 500.817          | 0,54                         |
| NOVA CHEMICALS 5 %<br>01/05/2025  | 1.509.000                | USD     | 1.487.693         | 1,59                         | LOGICOR FINANCING SARL<br>0,625 % 17.11.25      | 350.000                  | EUR     | 356.207          | 0,38                         |
|   |                          |         | <b>3.369.829</b>  | <b>3,60</b>                  | TELENET FINANCE LUX<br>NOTE 3,5 % 01.03.28      | 300.000                  | EUR     | 310.534          | 0,33                         |
| <b>FRANKREICH</b>   |                          |         |                   |                              |   |                          |         | <b>1.167.558</b> | <b>1,25</b>                  |
| FAURECIA 2,75 % 15.02.2027  | 550.000                  | EUR     | 569.322           | 0,60                         | <b>MACAU</b>                                    |                          |         |                  |                              |
| ILIAD HOLDING SASU<br>5,125 % 15.10.26  | 450.000                  | EUR     | 481.908           | 0,52                         | WYNN MACAU 5,5 %<br>15.01.26                    | 750.000                  | USD     | 731.023          | 0,78                         |
|   |                          |         |                   |                              |   |                          |         | <b>731.023</b>   | <b>0,78</b>                  |
|   |                          |         |                   |                              | <b>NIEDERLANDE</b>                              |                          |         |                  |                              |
|   |                          |         |                   |                              | CONSTELLIUM 4,25 %<br>15.02.26                  | 400.000                  | EUR     | 431.608          | 0,46                         |
|   |                          |         |                   |                              | DUFRY ONE 2 % 15.02.2027                        | 500.000                  | EUR     | 509.284          | 0,54                         |
|   |                          |         |                   |                              | GOODYEAR EUROPE 2,75 %<br>15.08.28              | 350.000                  | EUR     | 342.357          | 0,37                         |

\* Bis zum 2. Juli 2023 lautete der Name des Teilfonds „Global Short Duration High Yield Bond“.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

US Short Duration High Yield Bond\* (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung                                    | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|------------------|------------------------------|---|--------------------------|---------|-----------|------------------------------|
| QPARK HOLDING 2 %<br>01/03/2027                       | 300.000                  | EUR     | 305.057          | 0,33                         | CHSCOMMUNITY HEALTH<br>SYSTEMS 8 % 15.03.2026   | 494.000                  | USD     | 492.876   | 0,53                         |
| TRIVIUM PACKAGING<br>FINANCE 3,75 % 15.08.2026        | 300.000                  | EUR     | 315.067          | 0,34                         | CINEMARK 5,875 %<br>15.03.26                    | 590.000                  | USD     | 583.443   | 0,62                         |
| UPC HOLDING 3,875 %<br>15.06.29                       | 250.000                  | EUR     | 257.264          | 0,27                         | CIVITAS RESOURCES<br>8,375 % 01.07.28           | 811.000                  | USD     | 856.536   | 0,92                         |
| VZ VENDOR FINANCING<br>2,875 % 15.01.29               | 300.000                  | EUR     | 280.444          | 0,30                         | CLOUD SOFTWARE 6,5 %<br>31.03.29                | 500.000                  | USD     | 474.786   | 0,51                         |
| ZIGGO BOND FINANCE 6 %<br>15.01.27                    | 1.000.000                | USD     | 986.641          | 1,05                         | CROWNROCK 5,625 %<br>15.10.25                   | 875.000                  | USD     | 873.149   | 0,93                         |
|   |                          |         | <b>3.427.722</b> | <b>3,66</b>                  | CSC HOLDINGS 11,25 %<br>15.05.28                | 700.000                  | USD     | 694.525   | 0,74                         |
| <b>SPANIEN</b>  |                          |         |                  |                              | DAVE BUSTERS 7,625 %<br>01/11/2025              | 1.814.000                | USD     | 1.829.288 | 1,97                         |
| GRIFOLS ESCROW ISSUER<br>4,75 % 15.10.28              | 270.000                  | USD     | 223.605          | 0,24                         | DIRECTV HOLDINGS 5,875 %<br>15.08.27            | 600.000                  | USD     | 568.175   | 0,61                         |
|   |                          |         | <b>223.605</b>   | <b>0,24</b>                  | DISH NETWORK 11,75 %<br>15.11.27                | 715.000                  | USD     | 730.929   | 0,78                         |
| <b>SCHWEDEN</b>                                       |                          |         |                  |                              | EARTHSTONE ENERGY<br>HOLDINGS 8 % 15.04.27      | 750.000                  | USD     | 773.936   | 0,83                         |
| VOLVO CAR 4,25 %<br>31.05.28                          | 200.000                  | EUR     | 217.554          | 0,23                         | EQM MIDSTREAM PARTNERS<br>6 % 01.07.25          | 735.000                  | USD     | 736.493   | 0,79                         |
|   |                          |         | <b>217.554</b>   | <b>0,23</b>                  | ESAB 6,25 % 15.04.29                            | 122.000                  | USD     | 122.746   | 0,13                         |
| <b>USA</b>  |                          |         |                  |                              | FORD MOTOR CREDIT<br>4,389 % 01.08.26           | 1.800.000                | USD     | 1.756.841 | 1,89                         |
| AAR ESCROW ISSUER 6,75 %<br>15.03.29                  | 124.000                  | USD     | 125.186          | 0,13                         | FREEDOM MORTGAGE<br>HOLDINGS 9,25 % 01.02.29    | 100.000                  | USD     | 102.447   | 0,11                         |
| AMERICAN AIRLINES 8,5 %<br>15.05.29                   | 264.000                  | USD     | 279.020          | 0,30                         | FRONTIER COMMUNICATIONS<br>5,875 % 15.10.27     | 600.000                  | USD     | 581.588   | 0,62                         |
| AMERICAN AIRLINES<br>ADVANTAGE 5,5 % 20.04.26         | 1.500.000                | USD     | 1.119.891        | 1,20                         | GRAY TELEVISION 5,875 %<br>15.07.26             | 1.000.000                | USD     | 973.680   | 1,04                         |
| AMERICAN AXLE AND<br>MANUFACTURING 6,25 %<br>15.03.26 | 969.000                  | USD     | 963.227          | 1,03                         | HERC HOLDINGS 5,5 %<br>15.07.27                 | 1.046.000                | USD     | 1.029.254 | 1,10                         |
| ANTERO RESOURCES 8,375 %<br>15.07.26                  | 1.000.000                | USD     | 1.039.944        | 1,11                         | HOME POINT CAPITAL 5 %<br>01/02/2026            | 396.000                  | USD     | 387.987   | 0,41                         |
| ARDAGH PACKAGING<br>FINANCE 4,125 % 15.08.2026        | 1.700.000                | USD     | 1.544.703        | 1,66                         | IQVIA 1,75 % 15.03.26                           | 400.000                  | EUR     | 414.364   | 0,44                         |
| ASCENT RESOURCES UTICA<br>HOLDINGS 7 % 01.11.26       | 650.000                  | USD     | 652.812          | 0,70                         | JELD WEN 4,875 %<br>15.12.27                    | 400.000                  | USD     | 383.711   | 0,41                         |
| BLUE RACER MIDSTREAM<br>FINANCE 6,625 % 15.07.26      | 279.000                  | USD     | 278.860          | 0,30                         | KODIAK GAS SERVICES<br>7,25 % 15.02.29          | 70.000                   | USD     | 71.396    | 0,08                         |
| BLUE RACER MIDSTREAM<br>7,625 % 15.12.25              | 786.000                  | USD     | 794.271          | 0,85                         | LABL 9,5 % 01.11.28                             | 670.000                  | USD     | 679.329   | 0,73                         |
| BUCKEYE PARTNERS 4,125 %<br>01/03/2025                | 900.000                  | USD     | 881.057          | 0,94                         | MEDLINE BORROWER<br>LPMEDLINE 6,25 % 01.04.2029 | 254.000                  | USD     | 255.456   | 0,27                         |
| CARNIVAL HOLDINGS BERMUDA<br>10,375 % 01.05.28        | 1.281.000                | USD     | 1.398.725        | 1,49                         | MODIVCARE 5,875 %<br>15.11.25                   | 1.300.000                | USD     | 1.267.051 | 1,35                         |
| CCO HOLDINGS 5,5 %<br>01/05/2026                      | 1.975.000                | USD     | 1.950.131        | 2,09                         | MPT OPERATING PARTNERSHIP<br>3,325 % 24.03.25   | 300.000                  | EUR     | 305.828   | 0,33                         |
| CENTENE 4,25 % 15.12.2027                             | 500.000                  | USD     | 477.614          | 0,51                         | NATIONSTAR MORTGAGE<br>HOLDINGS 6 % 15.01.27    | 400.000                  | USD     | 395.427   | 0,42                         |
| CENTENNIAL RESOURCE PRODUC-<br>TION 6,875 % 01.04.27  | 571.000                  | USD     | 571.000          | 0,61                         | NAVIENT 6,75 % 25.06.25                         | 1.500.000                | USD     | 1.513.378 | 1,62                         |
| CHSCOMMUNITY HEALTH<br>SYSTEMS 5,625 % 15.03.27       | 1.000.000                | USD     | 919.690          | 0,98                         | NAVIENT 6,75 % 15.06.2026                       | 436.000                  | USD     | 440.334   | 0,47                         |

\* Bis zum 2. Juli 2023 lautete der Name des Teilfonds „Global Short Duration High Yield Bond“.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

US Short Duration High Yield Bond\* (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert  | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--------------------------|---------|-----------|------------------------------|--|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|
| NCL 8,125 % 15.01.29                                   | 428.000                  | USD     | 453.970   | 0,49                         | UNITED AIRLINES 4,375 %<br>15.04.26  | 1.200.000                | USD     | 1.161.517         | 1,24                         |
| NCL 8,375 % 01.02.28                                   | 144.000                  | USD     | 152.272   | 0,16                         | UNITED WHOLESALE<br>MORTGAGE 5,75 % 15.06.2027                                       | 1.875.000                | USD     | 1.825.786         | 1,96                         |
| NCR ATLEOS ESCROW 9,5 %<br>01/04/2029                  | 525.000                  | USD     | 561.884   | 0,60                         | VENTURE GLOBAL 8,125 %<br>01/06/2028   | 1.100.000                | USD     | 1.124.590         | 1,20                         |
| NORTONLIFELOCK 6,75 %<br>30.09.27                      | 750.000                  | USD     | 762.103   | 0,81                         | VICI PROPERTIES 5,75 %<br>01/02/2027   | 500.000                  | USD     | 499.916           | 0,53                         |
| PANTHER BF AGGREGATOR<br>8,5 % 15.05.27                | 928.000                  | USD     | 929.932   | 0,99                         | VIKING CRUISES 5,875 %<br>15.09.27   | 450.000                  | USD     | 442.163           | 0,47                         |
| PENNYMAC FINANCIAL<br>SERVICES 5,375 % 15.10.25        | 750.000                  | USD     | 741.955   | 0,79                         | VISTRA OPERATIONS 5,5 %<br>01/09/2026  | 1.436.000                | USD     | 1.415.460         | 1,51                         |
| PRAIRIE ACQUIROR 9 %<br>01/08/2029                     | 149.000                  | USD     | 153.901   | 0,16                         | WASH MULTIFAMILY ACQUISITION<br>5,75 % 15.04.26                                      | 508.000                  | USD     | 497.514           | 0,53                         |
| PRESIDIO HOLDINGS<br>4,875 % 01.02.27                  | 350.000                  | USD     | 340.675   | 0,36                         | WR GRACE HOLDINGS<br>4,875 % 15.06.27  | 450.000                  | USD     | 428.866           | 0,46                         |
| PRIME SECURITY SERVICES<br>BORROWER 5,75 %<br>15.04.26 | 500.000                  | USD     | 499.492   | 0,53                         | WYNDHAM DESTINATIONS<br>5,1 % 01.10.25   | 875.000                  | USD     | 883.362           | 0,94                         |
| PRIME SECURITY SERVICES<br>BORROWER 6,25 %<br>15.01.28 | 400.000                  | USD     | 392.345   | 0,42                         | <b>SUMME ANLEIHEN</b>  |                          |         | <b>56.886.443</b> | <b>60,79</b>                 |
| RITHM CAPITAL 6,25 %<br>15.10.25                       | 236.000                  | USD     | 234.459   | 0,25                         | <b>SUMME DER AN EINER GEREGELTEN<br/>MARKT GEHANDELTEN ÜBERTRAGBAREN WERTPAPIERE</b> |                          |         | <b>71.893.949</b> | <b>76,83</b>                 |
| RITHM CAPITAL 8 %<br>01/04/2029                        | 398.000                  | USD     | 386.410   | 0,41                         | <b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>   |                          |         |                   |                              |
| SEAGATE 8,25 % 15.12.29                                | 750.000                  | USD     | 807.477   | 0,86                         | <b>IRLAND</b>  |                          |         |                   |                              |
| SELECT MEDICAL 6,25 %<br>15.08.26                      | 599.000                  | USD     | 600.894   | 0,64                         | HSBC GLOBAL LIQUIDITY<br>FUND  | 1.442.997                | USD     | 1.442.997         | 1,54                         |
| SERVICE PROPERTIES<br>TRUST 7,5 % 15.09.25             | 1.250.000                | USD     | 1.267.004 | 1,35                         | <b>SUMME ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>                                       |                          |         | <b>1.442.997</b>  | <b>1,54</b>                  |
| SIRIUS XM RADIO 3,125 %<br>01/09/2026                  | 1.195.000                | USD     | 1.121.373 | 1,20                         | <b>SUMME WERTPAPIERANLAGEN</b>   |                          |         | <b>92.758.309</b> | <b>99,13</b>                 |
| SPRINGLEAF FINANCE<br>6,875 % 15.03.25                 | 1.000.000                | USD     | 1.010.981 | 1,08                         | <b>SONSTIGES NETTOVERMÖGEN</b>   |                          |         | <b>809.550</b>    | <b>0,87</b>                  |
| SPRINGLEAF FINANCE<br>7,125 % 15.03.26                 | 350.000                  | USD     | 356.879   | 0,38                         | <b>GESAMTNETTOVERMÖGEN</b>   |                          |         | <b>93.567.859</b> | <b>100,00</b>                |
| STANDARD INDUSTRIES 5 %<br>15.02.27                    | 1.500.000                | USD     | 1.458.627 | 1,56                         |  |                          |         |                   |                              |
| SUMMIT MATERIALS 7,25 %<br>15.01.31                    | 65.000                   | USD     | 67.616    | 0,07                         |  |                          |         |                   |                              |
| SUNOCO LP SUNOCO<br>FINANCE 6 % 15.04.27               | 800.000                  | USD     | 797.995   | 0,85                         |  |                          |         |                   |                              |
| TALLGRASS ENERGY<br>PARTNERS 6 % 01.03.2027            | 500.000                  | USD     | 492.609   | 0,53                         |  |                          |         |                   |                              |
| TALLGRASS ENERGY PARTNERS<br>7,375 % 15.02.29          | 254.000                  | USD     | 255.641   | 0,27                         |  |                          |         |                   |                              |
| TRANSDIGM 6,375 %<br>01/03/2029                        | 1.500.000                | USD     | 1.507.500 | 1,61                         |  |                          |         |                   |                              |
| UBER TECHNOLOGIES 8 %<br>01/11/2026                    | 950.000                  | USD     | 962.191   | 1,03                         |  |                          |         |                   |                              |

\* Bis zum 2. Juli 2023 lautete der Name des Teilfonds „Global Short Duration High Yield Bond“.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Emerging Markets Multi-Asset Income

Aufstellung der Wertpapiieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert       | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|----------------|------------------------------|--|--------------------------|---------|------------------|------------------------------|
| <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>  |                          |         |                |                              | <b>CHINA RAILWAY SIGNAL &amp; COMMUNICATION</b>                |                          |         |                  |                              |
| <b>AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |                          |         |                |                              | 17.879 CNY 13.519 0,03   |                          |         |                  |                              |
| <b>AKTIEN</b>   |                          |         |                |                              | CHINA SHENHUA ENERGY „H“ 13.556 HKD 53.261 0,11                |                          |         |                  |                              |
| <b>BRASILIEN</b>  |                          |         |                |                              | CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK 22.830 CNY 14.622 0,03         |                          |         |                  |                              |
| BANCO DO BRASIL   | 7.362                    | BRL     | 83.495         | 0,17                         | DONG FENG MOTOR „H“  | 120.285                  | HKD     | 50.257           | 0,11                         |
| BB SEGURIDADE   |                          |         |                |                              | GREE ELECTRIC APPLIANCES                                       | 7.847                    | CNY     | 42.367           | 0,09                         |
| PARTICIPACOES   | 8.473                    | BRL     | 55.420         | 0,12                         | GUANGZHOU KINGMED  |                          |         |                  |                              |
| CPFL ENERGIA  | 1.752                    | BRL     | 12.135         | 0,03                         | DIAGNOSTICS  | 1.029                    | CNY     | 8.022            | 0,02                         |
| JBS   | 12.222                   | BRL     | 53.034         | 0,11                         | HANGZHOU ROBAM   |                          |         |                  |                              |
| SUZANO PAPEL E CELULOSE   | 4.811                    | BRL     | 61.474         | 0,13                         | APPLIANCES   | 2.917                    | CNY     | 9.622            | 0,02                         |
| TIM SA/BRAZIL   | 21.461                   | BRL     | 75.931         | 0,16                         | HENGLI PETROCHEMICAL „A“                                       | 15.494                   | CNY     | 29.236           | 0,06                         |
| VALE  | 2.002                    | BRL     | 24.253         | 0,05                         | HUABEI MINING HOLDINGS   | 6.639                    | CNY     | 14.978           | 0,03                         |
| VIBRA ENERGIA   | 5.931                    | BRL     | 29.764         | 0,06                         | HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS                                       | 3.729                    | CNY     | 8.454            | 0,02                         |
|   |                          |         | <b>395.506</b> | <b>0,83</b>                  | HUBEI JUMPCAN  |                          |         |                  |                              |
| <b>CHILE</b>  |                          |         |                |                              | PHARMACEUTICAL 1.964 CNY 9.928 0,02                            |                          |         |                  |                              |
| BANCO DE CHILE  | 231.563                  | CLP     | 25.733         | 0,05                         | ICBC „H“   | 114.288                  | HKD     | 57.535           | 0,12                         |
| COMPANIA SUD AMERICANA DE VAPORES                                 | 222.176                  | CLP     | 16.694         | 0,04                         | <b>INDUSTRIAL &amp; COMMERCIAL</b>                             |                          |         |                  |                              |
| ENERSIS   | 612.500                  | CLP     | 36.781         | 0,08                         | BANK OF CHINA  | 47.475                   | CNY     | 34.329           | 0,07                         |
|   |                          |         | <b>79.208</b>  | <b>0,17</b>                  | KUAISHOU TECHNOLOGY  | 3.408                    | HKD     | 21.359           | 0,04                         |
| <b>CHINA</b>  |                          |         |                |                              | LI AUTO 970 HKD 15.034 0,03                                    |                          |         |                  |                              |
| AGRICULTURAL BANK OF CHINA  | 44.832                   | CNY     | 25.749         | 0,05                         | NETEASE  | 5.355                    | HKD     | 111.391          | 0,23                         |
| AGRICULTURAL BANK OF CHINA „H“                                    | 154.627                  | HKD     | 65.198         | 0,14                         | NEW CHINA LIFE   |                          |         |                  |                              |
| ALIBABA GROUP HOLDING   | 13.641                   | HKD     | 122.442        | 0,27                         | INSURANCE „H“  | 28.116                   | HKD     | 49.791           | 0,10                         |
| BANK OF BEIJING   | 51.964                   | CNY     | 40.438         | 0,09                         | SDIC CAPITAL   | 12.278                   | CNY     | 10.806           | 0,02                         |
| BANK OF CHINA „H“   | 99.504                   | HKD     | 41.066         | 0,09                         | SG MICRO   | 600                      | CNY     | 5.319            | 0,01                         |
| BANK OF COMMUNICATIONS „A“  | 25.838                   | CNY     | 22.242         | 0,05                         | SHENZHEN MINDRAY BIO MEDICAL ELECTRONICS 1.124 CNY 43.330 0,09 |                          |         |                  |                              |
| BANK OF COMMUNICATIONS „H“  | 40.124                   | HKD     | 26.351         | 0,06                         | TENCENT HOLDINGS   | 6.242                    | HKD     | 242.297          | 0,52                         |
| BEIJING WANTAI BIOLOGICAL PHARMACY ENTERPRISE                     | 2.407                    | CNY     | 23.021         | 0,05                         | TONGWEI  | 1.386                    | CNY     | 4.715            | 0,01                         |
| CHINA CONSTRUCTION BANK „H“                                       | 176.987                  | HKD     | 106.738        | 0,22                         | YANZHOU COAL MINING „H“  | 30.418                   | HKD     | 63.895           | 0,13                         |
| CHINA CONSTRUCTIONS BANK  | 11.117                   | CNY     | 10.458         | 0,02                         | YEALINK NETWORK TECHNOLOGY                                     | 3.669                    | CNY     | 12.689           | 0,03                         |
| CHINA COSCO HOLDINGS  | 24.833                   | CNY     | 35.503         | 0,07                         | ZHEJIANG EXPRESSWAY „H“  | 80.378                   | HKD     | 51.556           | 0,11                         |
| CHINA COSCO HOLDINGS „H“  | 37.668                   | HKD     | 39.610         | 0,08                         |  |                          |         | <b>1.731.366</b> | <b>3,65</b>                  |
| CHINA EVERBRIGHT BANK   | 157.009                  | HKD     | 45.138         | 0,10                         | <b>GRIECHENLAND</b>  |                          |         |                  |                              |
| CHINA HONGQIAO GROUP  | 57.659                   | HKD     | 64.831         | 0,14                         | GREEK ORGANISATION OF FOOTBALL PROGNOSTICS                     | 4.544                    | EUR     | 81.857           | 0,17                         |
| CHINA LIFE INSURANCE  | 3.898                    | CNY     | 15.301         | 0,03                         |  |                          |         | <b>81.857</b>    | <b>0,17</b>                  |
| CHINA NATIONAL BUILDINGS „H“                                      | 72.694                   | HKD     | 24.985         | 0,05                         | <b>HONGKONG</b>  |                          |         |                  |                              |
| CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP „H“                                 | 16.169                   | HKD     | 28.303         | 0,06                         | BEIJING ENTERPRISE   | 20.501                   | HKD     | 59.462           | 0,13                         |
| CHINA PETROLEUM & CHEMICAL „H“                                    | 27.639                   | HKD     | 15.680         | 0,03                         | CHINA RESOURCES POWER  | 4.001                    | HKD     | 9.335            | 0,02                         |
|   |                          |         |                |                              | CITIC PACIFIC  | 84.068                   | HKD     | 80.776           | 0,16                         |
|   |                          |         |                |                              | KINGBOARD CHEMICALS  | 3.800                    | HKD     | 7.749            | 0,02                         |
|   |                          |         |                |                              | LENOVO GROUP   | 61.211                   | HKD     | 70.937           | 0,15                         |
|   |                          |         |                |                              |  |                          |         | <b>228.259</b>   | <b>0,48</b>                  |
|   |                          |         |                |                              | <b>UNGARN</b>  |                          |         |                  |                              |
|   |                          |         |                |                              | MOL HUNGARIAN OIL AND GAS                                      | 2.865                    | HUF     | 23.275           | 0,05                         |
|   |                          |         |                |                              | RICHTER GEDEON   | 2.279                    | HUF     | 58.310           | 0,12                         |
|   |                          |         |                |                              |  |                          |         | <b>81.585</b>    | <b>0,17</b>                  |
|   |                          |         |                |                              | <b>INDIEN</b>  |                          |         |                  |                              |
|   |                          |         |                |                              | ASEA BROWN BOVERI INDIA  | 346                      | INR     | 26.388           | 0,06                         |
|   |                          |         |                |                              | AUROBINDO PHARMA   | 4.645                    | INR     | 60.637           | 0,13                         |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Emerging Markets Multi-Asset Income (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung                       | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung                          | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert       | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------------------------------|--------------------------|---------|------------------|------------------------------|---------------------------------------|--------------------------|---------|----------------|------------------------------|
| BAJAJ AUTO                         | 795                      | INR     | 87.201           | 0,18                         | <b>MEXIKO</b>                         |                          |         |                |                              |
| BHARAT ELECTRONICS                 | 35.005                   | INR     | 84.572           | 0,18                         | COCA-COLA FEMSA                       | 8.288                    | MXN     | 79.970         | 0,16                         |
| BHARTI AIRTEL                      | 1.956                    | INR     | 28.814           | 0,06                         | FIBRA UNO ADMINISTRATION              | 44.773                   | MXN     | 74.371         | 0,16                         |
| BRITANNIA INDUSTRIES               | 1.018                    | INR     | 59.946           | 0,13                         | GRUPO MEXICO „B“                      | 3.642                    | MXN     | 21.501         | 0,05                         |
| COAL INDIA                         | 6.110                    | INR     | 31.802           | 0,07                         | KIMBER „A“                            | 6.302                    | MXN     | 14.635         | 0,03                         |
| DIVIS LABORATORIES                 | 132                      | INR     | 5.453            | 0,01                         | WALMART DE MEXICO                     | 8.624                    | MXN     | 34.762         | 0,07                         |
| DR REDDYS LABORATORIES             | 1.183                    | INR     | 87.345           | 0,18                         |                                       |                          |         | <b>225.239</b> | <b>0,47</b>                  |
| GAIL INDIA                         | 33.250                   | INR     | 72.179           | 0,15                         | <b>PHILIPPINEN</b>                    |                          |         |                |                              |
| HDFC ASSET MANAGEMENT              | 1.545                    | INR     | 69.543           | 0,15                         | PHILIPPINE LONG                       |                          |         |                |                              |
| HERO MOTOCORP                      | 1.359                    | INR     | 76.947           | 0,16                         | DISTANCE TELEPHONE                    | 1.067                    | PHP     | 26.004         | 0,05                         |
| HINDUSTAN AERONAUTICS              | 695                      | INR     | 27.724           | 0,06                         |                                       |                          |         | <b>26.004</b>  | <b>0,05</b>                  |
| ICICI BANK                         | 725                      | INR     | 9.504            | 0,02                         | <b>POLEN</b>                          |                          |         |                |                              |
| INDIAN OIL CORP                    | 3.367                    | INR     | 6.772            | 0,01                         | BANK ZACHODNI WBK                     | 199                      | PLN     | 28.420         | 0,06                         |
| INFOSYS                            | 7.513                    | INR     | 134.945          | 0,28                         |                                       |                          |         | <b>28.420</b>  | <b>0,06</b>                  |
| ITC                                | 17.088                   | INR     | 87.763           | 0,18                         | <b>KATAR</b>                          |                          |         |                |                              |
| NESTLE INDIA                       | 2.863                    | INR     | 90.019           | 0,19                         | QATAR INDUSTRIES                      | 10.021                   | QAR     | 32.945         | 0,07                         |
| NTPC                               | 14.272                   | INR     | 57.463           | 0,12                         |                                       |                          |         | <b>32.945</b>  | <b>0,07</b>                  |
| ONGC                               | 3.715                    | INR     | 11.940           | 0,03                         | <b>SAUDI-ARABIEN</b>                  |                          |         |                |                              |
| POWER GRID CORPORATION<br>OF INDIA | 5.798                    | INR     | 19.250           | 0,04                         | AL RAJHI BANK                         | 2.822                    | SAR     | 62.527         | 0,13                         |
| RELIANCE INDUSTRIES                | 1.701                    | INR     | 60.608           | 0,13                         | ARABIAN INTERNET AND<br>COMMUNICATION | 279                      | SAR     | 28.134         | 0,06                         |
| SONA BLW PRECISION<br>FORGINGS     | 6.589                    | INR     | 55.772           | 0,12                         | BANQUE SAUDI FRANSI                   | 1.110                    | SAR     | 11.528         | 0,02                         |
| TATA CONSULTANCY<br>SERVICE        | 1.122                    | INR     | 52.147           | 0,11                         | DR SULAIMAN AL HABIB                  |                          |         |                |                              |
| TATA STEEL                         | 51.814                   | INR     | 96.822           | 0,20                         | MEDIC SERVICE GROUP                   | 168                      | SAR     | 14.047         | 0,03                         |
| TECH MAHINDRA                      | 591                      | INR     | 8.844            | 0,02                         | ELM                                   | 293                      | SAR     | 74.921         | 0,17                         |
| TORRENT                            |                          |         |                  |                              | JARIR MARKETING                       | 12.631                   | SAR     | 49.507         | 0,10                         |
| PHARMACEUTICALS                    | 1.919                    | INR     | 59.837           | 0,13                         | SAUDI ARABIAN                         |                          |         |                |                              |
| ZOMATO                             | 28.349                   | INR     | 61.897           | 0,13                         | FERTILIZER COMPANY                    | 216                      | SAR     | 7.061          | 0,01                         |
|                                    |                          |         | <b>1.532.134</b> | <b>3,23</b>                  | SAUDI ARABIAN OIL                     | 3.245                    | SAR     | 26.605         | 0,06                         |
| <b>INDONESIEN</b>                  |                          |         |                  |                              | SAUDI ARAMCO BASE OIL                 | 1.673                    | SAR     | 74.673         | 0,16                         |
| ADARO ENERGY                       | 385.733                  | IDR     | 65.688           | 0,14                         | SAUDI BASIC INDUSTRIES                | 1.009                    | SAR     | 21.011         | 0,04                         |
| BANK MANDIRI                       | 209.790                  | IDR     | 95.930           | 0,20                         | SAUDI ELECTRICITY                     | 3.241                    | SAR     | 17.093         | 0,04                         |
| BANK RAKYAT INDONESIA              | 114.996                  | IDR     | 43.881           | 0,09                         |                                       |                          |         | <b>387.107</b> | <b>0,82</b>                  |
|                                    |                          |         | <b>205.499</b>   | <b>0,43</b>                  | <b>SÜDAFRIKA</b>                      |                          |         |                |                              |
| <b>KUWAIT</b>                      |                          |         |                  |                              | ABSA GROUP                            | 1.145                    | ZAR     | 8.957          | 0,02                         |
| AGILITY                            | 9.562                    | KWD     | 20.703           | 0,05                         | EXXARO RESOURCES                      | 1.737                    | ZAR     | 15.500         | 0,03                         |
| MOBILE                             |                          |         |                  |                              | FIRSTRAND                             | 6.210                    | ZAR     | 20.244         | 0,04                         |
| TELEKOMMUNIKATION                  | 7.001                    | KWD     | 11.175           | 0,02                         | STANDARD BANK                         | 7.954                    | ZAR     | 77.809         | 0,17                         |
|                                    |                          |         | <b>31.878</b>    | <b>0,07</b>                  | VODACOM GROUP                         | 8.042                    | ZAR     | 41.853         | 0,09                         |
| <b>LUXEMBURG</b>                   |                          |         |                  |                              | WOOLWORTHS HOLDINGS                   | 1.531                    | ZAR     | 4.787          | 0,01                         |
| NEPI ROCKCASTLE                    | 4.209                    | ZAR     | 29.073           | 0,06                         |                                       |                          |         | <b>169.150</b> | <b>0,36</b>                  |
|                                    |                          |         | <b>29.073</b>    | <b>0,06</b>                  | <b>SÜDKOREA</b>                       |                          |         |                |                              |
| <b>MALAYSIA</b>                    |                          |         |                  |                              | DONGBU INSURANCE                      | 1.054                    | KRW     | 75.395         | 0,16                         |
| GENTING                            | 11.809                   | MYR     | 11.777           | 0,02                         | HANA FINANCIAL HOLDINGS               | 1.759                    | KRW     | 76.958         | 0,16                         |
| INARI AMERTON                      | 38.658                   | MYR     | 25.809           | 0,05                         | HYUDAI GLOVIS                         | 167                      | KRW     | 22.403         | 0,05                         |
| IOI CORP                           | 10.344                   | MYR     | 8.633            | 0,02                         | HYUNDAI MOBIS                         | 121                      | KRW     | 23.503         | 0,05                         |
| RHB CAPITAL                        | 14.335                   | MYR     | 17.082           | 0,04                         | KB FINANCIAL GROUP                    | 1.547                    | KRW     | 80.783         | 0,16                         |
| TELEKOM MALAYSIA                   | 10.373                   | MYR     | 13.172           | 0,03                         | KT & G                                | 665                      | KRW     | 46.284         | 0,10                         |
|                                    |                          |         | <b>76.473</b>    | <b>0,16</b>                  | KUMHO PETRO CHEMICAL                  | 164                      | KRW     | 17.116         | 0,04                         |
|                                    |                          |         |                  |                              | LG ENERGY SOLUTION                    | 81                       | KRW     | 24.157         | 0,05                         |
|                                    |                          |         |                  |                              | LG UPLUS CORP                         | 10.017                   | KRW     | 74.779         | 0,16                         |
|                                    |                          |         |                  |                              | POSCO                                 | 174                      | KRW     | 54.413         | 0,11                         |
|                                    |                          |         |                  |                              | SAMSUNG ELECTRONICS                   | 4.849                    | KRW     | 291.030        | 0,60                         |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Emerging Markets Multi-Asset Income (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung                                   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--------------------------|---------|------------------|------------------------------|--|--------------------------|---------|------------------|------------------------------|
| SAMSUNG FIRE & MARINE<br>INSURANCE             | 166                      | KRW     | 38.101           | 0,08                         | <b>ANLEIHEN</b>  |                          |         |                  |                              |
| SAMSUNG SECURITIES                             | 874                      | KRW     | 26.423           | 0,06                         | <b>ARGENTINIEN</b>                                     |                          |         |                  |                              |
| SK HYNIX                                       | 384                      | KRW     | 50.829           | 0,11                         | ARGENTINA (GOVT) 0,125 %                               |                          |         |                  |                              |
| SK TELECOM                                     | 781                      | KRW     | 30.921           | 0,07                         | 09/07/2035   | 130.000                  | USD     | 55.250           | 0,12                         |
| WOORI FINANCIAL GROUP                          | 7.425                    | KRW     | 80.469           | 0,17                         |  |                          |         | <b>55.250</b>    | <b>0,12</b>                  |
| WOORI INVESTMENT &<br>SECURITIES               | 6.257                    | KRW     | 54.797           | 0,12                         | <b>BRASILIEN</b>                                       |                          |         |                  |                              |
|  |                          |         | <b>1.068.361</b> | <b>2,25</b>                  | BRAZIL (GOVT) 0 %                                      |                          |         |                  |                              |
| <b>TAIWAN</b>                                  |                          |         |                  |                              | 01/07/2024   | 2.615                    | BRL     | 510.032          | 1,07                         |
| ACCTON TECHNOLOGY                              | 1.082                    | TWD     | 15.501           | 0,03                         | BRAZIL (GOVT) 10 %                                     |                          |         |                  |                              |
| ASE TECHNOLOGY HOLDING                         | 19.411                   | TWD     | 94.012           | 0,20                         | 01/01/2029   | 2.800                    | BRL     | 547.706          | 1,15                         |
| CATCHER TECHNOLOGY                             | 7.107                    | TWD     | 48.300           | 0,10                         | BRAZIL (GOVT) 10 %                                     |                          |         |                  |                              |
| CHINA DEVELOPMENT<br>FINANCIAL                 | 73.036                   | TWD     | 31.607           | 0,07                         | 01/01/2033   | 1.850                    | BRL     | 351.956          | 0,74                         |
| CHINATRUST FINANCIAL<br>HOLDING                | 21.993                   | TWD     | 22.265           | 0,05                         | BRAZIL LETRAS DO<br>TESOURO NACIONAL 0 %               |                          |         |                  |                              |
| EVERGREEN MAR CORP                             | 14.576                   | TWD     | 80.159           | 0,17                         | 01/10/2024   | 2.930                    | BRL     | 557.846          | 1,18                         |
| FAR EASTERN NEW CENTURY                        | 41.382                   | TWD     | 42.735           | 0,09                         |  |                          |         | <b>1.967.540</b> | <b>4,14</b>                  |
| GLOBALWAFERS                                   | 3.591                    | TWD     | 62.275           | 0,13                         | <b>CHILE</b>   |                          |         |                  |                              |
| LARGAN PRECISION                               | 747                      | TWD     | 56.719           | 0,12                         | BONOS DE LA TESORERIA DE LA<br>REPUBLIC 6 % 01.04.2033 | 15.000.000               | CLP     | 15.079           | 0,03                         |
| LITE-ON TECHNOLOGY                             | 22.258                   | TWD     | 73.722           | 0,16                         | CHILE (GOVT) 4,5 %                                     |                          |         |                  |                              |
| MEDIATEK                                       | 2.002                    | TWD     | 72.565           | 0,15                         | 01/03/2026   | 80.000.000               | CLP     | 79.963           | 0,17                         |
| NAN YA PRINTED CIRCUIT<br>VERWALTUNGSRAT       | 2.551                    | TWD     | 15.783           | 0,03                         | CHILE (GOVT) 4,7 %                                     |                          |         |                  |                              |
| NIEN MADE ENTERPRISE                           | 5.960                    | TWD     | 66.112           | 0,14                         | 01/09/2030   | 135.000.000              | CLP     | 130.138          | 0,27                         |
| NOVATEK MICROELECTRONIC                        | 3.517                    | TWD     | 64.728           | 0,14                         | CORP NACIONAL DEL COBRE                                |                          |         |                  |                              |
| TAISHIN FINANCIAL                              | 18.339                   | TWD     | 10.286           | 0,02                         | 5,125 % 02.02.33                                       | 400.000                  | USD     | 380.547          | 0,80                         |
| TAIWAN SEMICONDUCTOR<br>VERARBEITENDES GEWERBE | 32.522                   | TWD     | 781.458          | 1,65                         | CORP NACIONAL DEL COBRE                                |                          |         |                  |                              |
| UNITED MICRO ELECTRONICS                       | 35.743                   | TWD     | 58.076           | 0,12                         | DE CHILE 6,44 % 26.01.36                               | 200.000                  | USD     | 206.779          | 0,44                         |
| WAN HAI LINES                                  | 5.785                    | TWD     | 7.954            | 0,02                         | EMPRESA NACIONAL DEL<br>PETROLEO 6,15 % 10.05.33       | 200.000                  | USD     | 202.766          | 0,43                         |
| YUANTA FINANCIAL HOLDINGS                      | 9.784                    | TWD     | 9.202            | 0,02                         |  |                          |         | <b>1.015.272</b> | <b>2,14</b>                  |
|  |                          |         | <b>1.613.459</b> | <b>3,41</b>                  | <b>KOLUMBIEN</b>                                       |                          |         |                  |                              |
| <b>THAILAND</b>                                |                          |         |                  |                              | COLOMBIA (GOVT) 7 %                                    |                          |         |                  |                              |
| KRUNG THAI BANK                                | 71.334                   | THB     | 32.844           | 0,07                         | 26.03.31   | 200.000.000              | COP     | 45.058           | 0,09                         |
| LAND AND HOUSES                                | 212.194                  | THB     | 42.744           | 0,09                         | COLOMBIA (GOVT) 7,25 %                                 |                          |         |                  |                              |
| PTT E&P  | 3.586                    | THB     | 14.644           | 0,03                         | 18.10.34   | 200.000.000              | COP     | 42.401           | 0,09                         |
|  |                          |         | <b>90.232</b>    | <b>0,19</b>                  | COLOMBIA (GOVT) 7,5 %                                  |                          |         |                  |                              |
| <b>TÜRKEI</b>                                  |                          |         |                  |                              | 02/02/2034   | 30.000                   | USD     | 30.653           | 0,06                         |
| FORD OTOMOTIV SANAYI                           | 596                      | TRY     | 21.278           | 0,04                         | COLOMBIA (GOVT) 8 %                                    |                          |         |                  |                              |
| SABANCI HOLDING                                | 24.419                   | TRY     | 62.573           | 0,14                         | 20.04.33   | 200.000                  | USD     | 211.731          | 0,45                         |
| TURK HAVA YOLLARI                              | 1.260                    | TRY     | 11.596           | 0,02                         | COLOMBIA (GOVT) 8,75 %                                 |                          |         |                  |                              |
| TURKIYE IS BANKASI „C“                         | 18.329                   | TRY     | 6.362            | 0,01                         | 14.11.53   | 200.000                  | USD     | 217.701          | 0,46                         |
|  |                          |         | <b>101.809</b>   | <b>0,21</b>                  | ECOPETROL 5,875 %                                      |                          |         |                  |                              |
| <b>VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE</b>            |                          |         |                  |                              | 28.05.45   | 60.000                   | USD     | 44.869           | 0,09                         |
| ABU DHABI ISLAMIC BANK                         | 8.635                    | AED     | 25.678           | 0,05                         | ECOPETROL 8,625 %                                      |                          |         |                  |                              |
| ALDAR PROPERTIES                               | 32.982                   | AED     | 49.578           | 0,10                         | 19.01.29   | 100.000                  | USD     | 106.051          | 0,22                         |
| AMERICANA RESTAURANTS<br>INTERNATIONAL         | 18.848                   | AED     | 16.886           | 0,04                         | TITULOS DE TESORERIA B                                 |                          |         |                  |                              |
|  |                          |         | <b>92.142</b>    | <b>0,19</b>                  | 7,5 % 26.08.26   | 650.000.000              | COP     | 162.449          | 0,34                         |
| <b>SUMME AKTIEN</b>                            |                          |         | <b>8.307.706</b> | <b>17,50</b>                 | TITULOS DE TESORERIA B                                 |                          |         |                  |                              |
|  |                          |         |                  |                              | 7,75 % 18.09.30  | 1.245.100.000            | COP     | 294.270          | 0,63                         |
|  |                          |         |                  |                              |  |                          |         | <b>1.155.183</b> | <b>2,43</b>                  |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Emerging Markets Multi-Asset Income (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapiieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung                             | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--------------------------|---------|------------------|------------------------------|---|--------------------------|---------|------------------|------------------------------|
| <b>ÄGYPTEN</b>                           |                          |         |                  |                              | <b>LUXEMBURG</b>                                    |                          |         |                  |                              |
| EGYPT (GOVT) 8,7002 %<br>01/03/2049      | 200.000                  | USD     | 162.356          | 0,34                         | ACU PETROLEO LUXEMBOURG<br>7,5 % 13.07.35           | 250.000                  | USD     | 235.978          | 0,50                         |
|  |                          |         | <b>162.356</b>   | <b>0,34</b>                  |   |                          |         | <b>235.978</b>   | <b>0,50</b>                  |
| <b>EL SALVADOR</b>                       |                          |         |                  |                              | <b>MACAU</b>  |                          |         |                  |                              |
| EL SALVADOR (GOVT)<br>8,25 % 10.04.32    | 50.000                   | USD     | 41.730           | 0,09                         | SANDS CHINA 5,125 %<br>08/08/2025                   | 761.000                  | USD     | 750.928          | 1,58                         |
| EL SALVADOR (GOVT)<br>8,625 % 28.02.29   | 90.000                   | USD     | 78.667           | 0,16                         |   |                          |         | <b>750.928</b>   | <b>1,58</b>                  |
|  |                          |         | <b>120.397</b>   | <b>0,25</b>                  | <b>MALAYSIA</b>                                     |                          |         |                  |                              |
| <b>UNGARN</b>                            |                          |         |                  |                              | MALAYSIA (GOVT) 3,465 %<br>15.10.30                 | 595.000                  | MYR     | 123.569          | 0,26                         |
| HUNGARY (GOVT) 4,5 %<br>23.03.28         | 52.200.000               | HUF     | 132.449          | 0,28                         | MALAYSIA (GOVT) 3,899 %<br>16.11.27                 | 1.080.000                | MYR     | 231.267          | 0,49                         |
| HUNGARY (GOVT) 4,75 %<br>24.11.32        | 50.500.000               | HUF     | 121.204          | 0,26                         | MALAYSIA (GOVT) 4,065 %<br>15.06.50                 | 200.000                  | MYR     | 41.556           | 0,09                         |
| HUNGARY (GOVT) 5,25 %<br>16.06.29        | 200.000                  | USD     | 198.224          | 0,42                         | MALAYSIA (GOVT) 4,254 %<br>31.05.35                 | 700.000                  | MYR     | 152.698          | 0,32                         |
| HUNGARY (GOVT) 5,5 %<br>26.03.36         | 200.000                  | USD     | 194.640          | 0,41                         |   |                          |         | <b>549.090</b>   | <b>1,16</b>                  |
| HUNGARY (GOVT) 6,75 %<br>25.09.52        | 200.000                  | USD     | 214.994          | 0,45                         | <b>MEXIKO</b>                                       |                          |         |                  |                              |
| MVM ENERGETIKA 6,5 %<br>13.03.31         | 200.000                  | USD     | 199.303          | 0,42                         | BBVA BANCOMER 8,45 % VRN<br>29.06.38                | 200.000                  | USD     | 211.267          | 0,44                         |
|  |                          |         | <b>1.060.814</b> | <b>2,24</b>                  | COMISION FEDERAL DE ELECTRICIDA<br>4,688 % 15.05.29 | 200.000                  | USD     | 188.293          | 0,40                         |
| <b>INDONESIEN</b>                        |                          |         |                  |                              | MEX BONOS DESARR 5,75 %<br>05/03/2026               | 26.000                   | MXN     | 144.802          | 0,30                         |
| INDONESIA (GOVT) 4,2 %<br>15.10.50       | 350.000                  | USD     | 296.019          | 0,62                         | MEXICO (GOVT) 7,5 %<br>03/06/2027                   | 109.000                  | MXN     | 620.980          | 1,31                         |
| INDONESIA (GOVT) 5,1 %<br>10/02/2054     | 200.000                  | USD     | 193.923          | 0,41                         | MEXICAN (GOVT) 7,5 %<br>26.05.33                    | 30.000                   | MXN     | 161.370          | 0,34                         |
| INDONESIA (GOVT) 6,625 %<br>15.05.33     | 1.260.000.000            | IDR     | 79.398           | 0,17                         | MEXICO (GOVT) 8,5 %<br>18.11.38                     | 82.000                   | MXN     | 460.529          | 0,97                         |
| INDONESIA (GOVT) 7 %<br>15.02.33         | 3.500.000.000            | IDR     | 226.032          | 0,48                         | MEXICO CITY AIRPORT<br>TRUST 4,25 % 31.10.26        | 200.000                  | USD     | 193.548          | 0,41                         |
| INDONESIA (GOVT) 7,5 %<br>15.06.35       | 6.058.000.000            | IDR     | 404.580          | 0,85                         | MEXICO CITY AIRPORT<br>TRUST 5,5 % 31.07.47         | 200.000                  | USD     | 169.028          | 0,36                         |
| INDONESIA (GOVT) 7,5 %<br>15.05.38       | 2.000.000.000            | IDR     | 133.433          | 0,28                         | PETROLEOS MEXICANOS<br>6,5 % 13.03.27               | 235.000                  | USD     | 221.586          | 0,47                         |
|  |                          |         | <b>1.333.385</b> | <b>2,81</b>                  |   |                          |         | <b>2.371.403</b> | <b>5,00</b>                  |
| <b>Elfenbeinküste</b>                    |                          |         |                  |                              | <b>NIGERIA</b>                                      |                          |         |                  |                              |
| IVORY COAST (GOVT)<br>7,625 % 30.01.33   | 200.000                  | USD     | 198.842          | 0,42                         | NIGERIA (GOVT) 7,143 %<br>23.02.30                  | 200.000                  | USD     | 182.270          | 0,38                         |
|  |                          |         | <b>198.842</b>   | <b>0,42</b>                  | NIGERIA (GOVT) 7,625 %<br>28.11.47                  | 200.000                  | USD     | 155.959          | 0,33                         |
| <b>KASACHSTAN</b>                        |                          |         |                  |                              |   |                          |         | <b>338.229</b>   | <b>0,71</b>                  |
| KAZMUNAYGAS NATIONAL<br>4,75 % 19.04.27  | 400.000                  | USD     | 390.432          | 0,82                         | <b>OMAN</b>   |                          |         |                  |                              |
| KAZMUNAYGAS NATIONAL<br>6,375 % 24.10.48 | 200.000                  | USD     | 187.860          | 0,40                         | LAMAR FUNDING 3,958 %<br>07/05/2025                 | 200.000                  | USD     | 195.269          | 0,41                         |
|  |                          |         | <b>578.292</b>   | <b>1,22</b>                  |   |                          |         | <b>195.269</b>   | <b>0,41</b>                  |
| <b>KENIA</b>                             |                          |         |                  |                              | <b>PERU</b>   |                          |         |                  |                              |
| KENYA (GOVT) 9,75 %<br>16.02.31          | 200.000                  | USD     | 205.248          | 0,43                         | PERUVIAN (GOVT) 5,4 %<br>12/08/2034                 | 500.000                  | PEN     | 116.082          | 0,24                         |
|  |                          |         | <b>205.248</b>   | <b>0,43</b>                  | PETROLEOS DEL PERU<br>4,75 % 19.06.32               | 260.000                  | USD     | 204.553          | 0,44                         |
|  |                          |         |                  |                              |   |                          |         | <b>320.635</b>   | <b>0,68</b>                  |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Emerging Markets Multi-Asset Income (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung                             | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert       | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--------------------------|---------|----------------|------------------------------|---|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|
| <b>POLEN</b>                             |                          |         |                |                              | <b>TRINIDAD &amp; TOBAGO</b>  |                          |         |                   |                              |
| POLAND (GOVT) 0,25 %<br>25.10.26         | 1.700.000                | PLN     | 377.319        | 0,80                         | TRINIDAD & TOBAGO<br>(GOVT) 5,95 % 14.01.2031                                       | 200.000                  | USD     | 201.012           | 0,42                         |
| POLAND (GOVT) 1,75 %<br>25.04.32         | 800.000                  | PLN     | 153.926        | 0,32                         |   |                          |         | <b>201.012</b>    | <b>0,42</b>                  |
| POLAND (GOVT) 2,5 %<br>25.07.26          | 900.000                  | PLN     | 213.135        | 0,45                         | <b>TÜRKEI</b>   |                          |         |                   |                              |
| POLAND (GOVT) 5,5 %<br>04/04/2053        | 76.000                   | USD     | 75.952         | 0,16                         | TURKEY (GOVT) 10,5 %<br>11/08/2027  | 3.100.000                | TRY     | 58.516            | 0,12                         |
|  |                          |         | <b>820.332</b> | <b>1,73</b>                  | TURKEY (GOVT) 16,9 %<br>02/09/2026  | 1.100.000                | TRY     | 23.873            | 0,05                         |
| <b>KATAR</b>                             |                          |         |                |                              |   |                          |         | <b>82.389</b>     | <b>0,17</b>                  |
| QATAR (GOVT) 4,817 %<br>14.03.49         | 255.000                  | USD     | 239.458        | 0,50                         | <b>UKRAINE</b>  |                          |         |                   |                              |
| QATAR (GOVT) 5,103 %<br>23.04.48         | 310.000                  | USD     | 302.371        | 0,64                         | UKRAINE (GOVT) 0 % VRN<br>31.05.40  | 140.000                  | USD     | 78.045            | 0,16                         |
|  |                          |         | <b>541.829</b> | <b>1,14</b>                  | UKRAINE (GOVT) 7,75 %<br>01/09/2027   | 100.000                  | USD     | 33.160            | 0,07                         |
| <b>RUMÄNIEN</b>                          |                          |         |                |                              |   |                          |         | <b>111.205</b>    | <b>0,23</b>                  |
| ROMANIA (GOVT) 3,65 %<br>24.09.31        | 400.000                  | RON     | 72.899         | 0,15                         | <b>VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE</b>   |                          |         |                   |                              |
| ROMANIA (GOVT) 5,125 %<br>15.06.48       | 74.000                   | USD     | 62.947         | 0,13                         | ABU DHABI (GOVT) 3,875 %<br>16.04.50  | 200.000                  | USD     | 160.474           | 0,34                         |
| ROMANIA (GOVT) 5,8 %<br>26.07.27         | 1.900.000                | RON     | 408.736        | 0,87                         | ABU DHABI NATIONAL<br>ENERGY 4 % 03.10.49   | 200.000                  | USD     | 162.658           | 0,34                         |
| ROMANIAN (GOVT) 6,375 %<br>30.01.34      | 124.000                  | USD     | 125.995        | 0,27                         |   |                          |         | <b>323.132</b>    | <b>0,68</b>                  |
| ROMANIA (GOVT) 7,625 %<br>17.01.53       | 100.000                  | USD     | 111.120        | 0,23                         | <b>URUGUAY</b>  |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         | <b>781.697</b> | <b>1,65</b>                  | URUGUAY (GOVT) 5,75 %<br>28.10.34   | 130.000                  | USD     | 137.410           | 0,29                         |
| <b>SAUDI-ARABIEN</b>                     |                          |         |                |                              |   |                          |         | <b>137.410</b>    | <b>0,29</b>                  |
| GACI FIRST INVESTMENT<br>4,75 % 14.02.30 | 200.000                  | USD     | 196.182        | 0,41                         | <b>SUMME ANLEIHEN</b>   |                          |         |                   |                              |
| SAUDI ARABIA (GOVT)<br>3,45 % 02.02.61   | 200.000                  | USD     | 133.685        | 0,28                         |   |                          |         | <b>17.097.250</b> | <b>36,02</b>                 |
| SAUDI ARABIA (GOVT)<br>5,25 % 16.01.50   | 200.000                  | USD     | 189.126        | 0,40                         | <b>DEPOSITARY RECEIPTS</b>  |                          |         |                   |                              |
| SAUDI ARABIA (GOVT) 5,75 %<br>16.01.54   | 200.000                  | USD     | 198.317        | 0,42                         | <b>BRASILIEN</b>  |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         | <b>717.310</b> | <b>1,51</b>                  | AMBEV   | 20.275                   | USD     | 50.181            | 0,11                         |
| <b>SÜDAFRIKA</b>                         |                          |         |                |                              |   |                          |         | <b>50.181</b>     | <b>0,11</b>                  |
| SOUTH AFRICA (GOVT)<br>8,5 % 31.01.37    | 700.000                  | ZAR     | 27.317         | 0,06                         | <b>CHINA</b>  |                          |         |                   |                              |
| SOUTH AFRICA (GOVT) 9 %<br>31.01.40      | 7.500.000                | ZAR     | 292.636        | 0,62                         | PINDUODUO   | 1.173                    | USD     | 136.877           | 0,28                         |
|  |                          |         | <b>319.953</b> | <b>0,68</b>                  |   |                          |         | <b>136.877</b>    | <b>0,28</b>                  |
| <b>THAILAND</b>                          |                          |         |                |                              | <b>SUMME DEPOSITARY RECEIPTS</b>  |                          |         |                   |                              |
| THAILAND (GOVT) 1,585 %<br>17.12.35      | 8.300.000                | THB     | 204.561        | 0,43                         |   |                          |         | <b>187.058</b>    | <b>0,39</b>                  |
| THAILAND (GOVT) 3,3 %<br>17.06.38        | 8.300.000                | THB     | 242.309        | 0,51                         | <b>VORZUGSAKTIEN</b>  |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         | <b>446.870</b> | <b>0,94</b>                  | <b>BRASILIEN</b>  |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                |                              | BANCO BRADESCO  | 26.544                   | BRL     | 76.203            | 0,16                         |
|  |                          |         |                |                              |   |                          |         | <b>76.203</b>     | <b>0,16</b>                  |
|  |                          |         |                |                              | <b>KOLUMBIEN</b>  |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                |                              | BANCOLOMBIA   | 7.820                    | COP     | 66.521            | 0,14                         |
|  |                          |         |                |                              |   |                          |         | <b>66.521</b>     | <b>0,14</b>                  |
|  |                          |         |                |                              | <b>SÜDKOREA</b>   |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                |                              | SAMSUNG ELECTRONICS   | 693                      | KRW     | 34.592            | 0,07                         |
|  |                          |         |                |                              |   |                          |         | <b>34.592</b>     | <b>0,07</b>                  |
|  |                          |         |                |                              | <b>SUMME VORZUGSAKTIEN</b>  |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                |                              | <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN<br/>BÖRSE NOTIERTEN WERTPAPIERE<br/>WERTPAPIERE</b> |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         |                |                              |   |                          |         | <b>25.769.330</b> | <b>54,28</b>                 |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Emerging Markets Multi-Asset Income (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung                | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--------------------------|---------|----------|------------------------------|-----------------------------|--------------------------|---------|----------|------------------------------|
| <b>AN EINEM ANDEREM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE, ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |                          |         |          |                              | <b>DOMINIC (GOVT) 6 %</b>   |                          |         |          |                              |
| <b>AKTIEN</b>  |                          |         |          |                              | 22.02.33                    |                          |         |          |                              |
| <b>CHINA</b>   |                          |         |          |                              | 150.000 USD                 |                          |         |          |                              |
| NEW ORIENTAL EDUCATION AND TECHNOLOGY  |                          |         |          |                              | 146.082 0,30                |                          |         |          |                              |
| 5.361 HKD  |                          |         |          |                              | <b>419.824 0,88</b>         |                          |         |          |                              |
| 46.682 0,10  |                          |         |          |                              | <b>LUXEMBURG</b>            |                          |         |          |                              |
| <b>46.682 0,10</b>   |                          |         |          |                              | CHILE ELECTRICITY 6,01 %    |                          |         |          |                              |
| <b>SÜDKOREA</b>  |                          |         |          |                              | 20.01.33                    |                          |         |          |                              |
| INDUSTRIAL BANK OF KOREA   |                          |         |          |                              | 200.000 USD                 |                          |         |          |                              |
| 6.783 KRW  |                          |         |          |                              | 202.971 0,43                |                          |         |          |                              |
| 70.286 0,15  |                          |         |          |                              | EIG PEARL HOLDINGS          |                          |         |          |                              |
| <b>70.286 0,15</b>   |                          |         |          |                              | 3.545 % 31.08.36            |                          |         |          |                              |
| <b>SUMME AKTIEN</b>  |                          |         |          |                              | 200.000 USD                 |                          |         |          |                              |
| <b>116.968 0,25</b>  |                          |         |          |                              | MILLICOM INTERNATIONAL      |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | CELLULAR 7,375 % 02.04.2032 |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 200.000 USD                 |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 200.000 0,42                |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | <b>574.269 1,21</b>         |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | <b>MALAYSIA</b>             |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | MALAYSIA (GOVT) 3,757 %     |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 22.05.40                    |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 900.000 MYR                 |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 184.860 0,39                |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | <b>184.860 0,39</b>         |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | <b>MEXIKO</b>               |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | BANCO MERCANTIL DEL NORTE   |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | SAGRAN 5,875 % VRN PERP     |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 200.000 USD                 |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | MEXICO (GOVT) 4,5 %         |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 22.04.29                    |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 380.000 USD                 |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 368.135 0,78                |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | PETROLEOS MEXICANOS         |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 6,875 % 04.08.26            |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 100.000 USD                 |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 97.112 0,20                 |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | PETROLEOS MEXICANOS         |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 7,69 % 23.01.50             |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 205.000 USD                 |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 147.232 0,31                |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | <b>803.906 1,69</b>         |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | <b>NIEDERLANDE</b>          |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | PROSUS 3,257 % 19.01.27     |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 200.000 USD                 |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 185.592 0,39                |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | <b>185.592 0,39</b>         |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | <b>PERU</b>                 |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | PERU (GOVT) 2,78 %          |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 01/12/2060                  |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 150.000 USD                 |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 86.823 0,18                 |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | PERU (GOVT) 3 % 15.01.2034  |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 107.000 USD                 |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 87.800 0,18                 |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | PERU (GOVT) 3,3 %           |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 11/03/2041                  |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 100.000 USD                 |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 75.244 0,16                 |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | PERU (GOVT) 6,95 %          |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 12/08/2031                  |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 800.000 PEN                 |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 216.240 0,46                |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | <b>466.107 0,98</b>         |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | <b>POLEN</b>                |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | POLAND (GOVT) 5,5 %         |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 18.03.54                    |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 60.000 USD                  |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 59.753 0,13                 |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | <b>59.753 0,13</b>          |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | <b>SÜDAFRIKA</b>            |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | SOUTH AFRICA (GOVT)         |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 8,875 % 28.02.35            |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 8.200.000 ZAR               |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 345.632 0,73                |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | <b>345.632 0,73</b>         |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | <b>USA</b>                  |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | KOSMOS ENERGY 7,75 %        |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 01/05/2027                  |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 200.000 USD                 |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 197.703 0,42                |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | <b>197.703 0,42</b>         |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | <b>URUGUAY</b>              |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | URUGUAY (GOVT) 5,1 %        |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 18.06.50                    |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 300.000 USD                 |                          |         |          |                              |
|  |                          |         |          |                              | 290.703 0,61                |                          |         |          |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Global Emerging Markets Multi-Asset Income (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung                                       | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung                                   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--------------------------|---------|------------------|------------------------------|--|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|
| URUGUAY (GOVT) 8,25 %<br>21.05.31                  | 800.000                  | UYU     | 20.429           | 0,04                         | <b>ANLEIHEN</b>                                |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         | <b>311.132</b>   | <b>0,65</b>                  | <b>CHILE</b>                                   |                          |         |                   |                              |
| <b>SUMME ANLEIHEN</b>                              |                          |         | <b>5.087.953</b> | <b>10,71</b>                 | CORP NACIONAL DEL COBRE                        |                          |         |                   |                              |
| <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN</b>                |                          |         | <b>5.204.921</b> | <b>10,96</b>                 | DE CHILE 3 % 30.09.29                          | 240.000                  | USD     | 212.613           | 0,45                         |
| <b>MARKT GEHANDELTEN ÜBERTRAGBAREN WERTPAPIERE</b> |                          |         |                  |                              |  |                          |         | <b>212.613</b>    | <b>0,45</b>                  |
| <b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>           |                          |         |                  |                              | <b>MALAYSIA</b>                                |                          |         |                   |                              |
| <b>IRLAND</b>                                      |                          |         |                  |                              | MALAYSIA (GOVT) 3,955 %<br>15.09.25            | 1.675.000                | MYR     | 357.161           | 0,74                         |
| HSBC GLOBAL LIQUIDITY<br>FUND                      | 3.265.174                | USD     | 3.265.173        | 6,87                         |  |                          |         | <b>357.161</b>    | <b>0,74</b>                  |
| L&G INDIA INR GOVERNMENT<br>BOND UCITS ETF         | 170.963                  | USD     | 1.513.194        | 3,19                         | <b>PERU</b>                                    |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         | <b>4.778.367</b> | <b>10,06</b>                 | PERU (GOVT) 6,35 %<br>12/08/2028               | 200.000                  | PEN     | 55.158            | 0,12                         |
| <b>LUXEMBURG</b>                                   |                          |         |                  |                              |  |                          |         | <b>55.158</b>     | <b>0,12</b>                  |
| HGIF ASIA HIGH YIELD<br>BOND INC                   | 579.841                  | USD     | 3.079.536        | 6,49                         | <b>POLEN</b>                                   |                          |         |                   |                              |
| LYXOR MSCI BRAZIL UCITS<br>ETF ACC                 | 10.272                   | USD     | 234.150          | 0,49                         | POLAND (GOVT) 2,5 %<br>25.07.27                | 200.000                  | PLN     | 46.193            | 0,10                         |
|  |                          |         | <b>3.313.686</b> | <b>6,98</b>                  |  |                          |         | <b>46.193</b>     | <b>0,10</b>                  |
| <b>SUMME ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>     |                          |         | <b>8.092.053</b> | <b>17,04</b>                 | <b>SUMME ANLEIHEN</b>                          |                          |         | <b>671.125</b>    | <b>1,41</b>                  |
| <b>GELDMARKTINSTRUMENTE</b>                        |                          |         |                  |                              | <b>VORZUGSAKTIE</b>                            |                          |         |                   |                              |
| <b>SCHATZWECHSEL</b>                               |                          |         |                  |                              | <b>RUSSISCHE FÖDERATION</b>                    |                          |         |                   |                              |
| <b>USA</b>   |                          |         |                  |                              | SURGUTNEFTEGAZ*                                | 218.700                  | RUB     | -                 | 0,00                         |
| US (GOVT) 0 % 04.04.24                             | 1.500.000                | USD     | 1.499.356        | 3,16                         |  |                          |         | -                 | <b>0,00</b>                  |
| US (GOVT) 0 % 16.05.24                             | 1.800.000                | USD     | 1.788.288        | 3,77                         | <b>SUMME VORZUGSAKTIE</b>                      |                          |         | -                 | <b>0,00</b>                  |
| US (GOVT) 0 % 13.06.24                             | 900.000                  | USD     | 890.490          | 1,88                         | <b>SUMME SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |                          |         | <b>671.125</b>    | <b>1,41</b>                  |
| US (GOVT) 0 % 11.07.24                             | 2.100.000                | USD     | 2.069.721        | 4,35                         | <b>SUMME WERTPAPIERANLAGEN</b>                 |                          |         | <b>47.064.115</b> | <b>99,12</b>                 |
| US (GOVT) 0 % 15.08.24                             | 1.100.000                | USD     | 1.078.831        | 2,27                         | <b>SONSTIGES NETTOVERMÖGEN</b>                 |                          |         | <b>416.977</b>    | <b>0,88</b>                  |
|  |                          |         | <b>7.326.686</b> | <b>15,43</b>                 | <b>GESAMTNETTOVERMÖGEN</b>                     |                          |         | <b>47.481.092</b> | <b>100,00</b>                |
| <b>SUMME SCHATZWECHSEL</b>                         |                          |         | <b>7.326.686</b> | <b>15,43</b>                 |  |                          |         |                   |                              |
| <b>GELDMARKTINSTRUMENTE GESAMT</b>                 |                          |         |                  |                              |  |                          |         |                   |                              |
| <b>SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>           |                          |         |                  |                              |  |                          |         |                   |                              |
| <b>AKTIEN</b>                                      |                          |         |                  |                              |  |                          |         |                   |                              |
| <b>RUSSISCHE FÖDERATION</b>                        |                          |         |                  |                              |  |                          |         |                   |                              |
| GAZPROM*   | 17.530                   | RUB     | -                | 0,00                         |  |                          |         |                   |                              |
| POLYUS GOLD*                                       | 613                      | RUB     | -                | 0,00                         |  |                          |         |                   |                              |
| SBERBANK*  | 66.813                   | RUB     | -                | 0,00                         |  |                          |         |                   |                              |
| TATNEFT*   | 20.867                   | RUB     | -                | 0,00                         |  |                          |         |                   |                              |
|  |                          |         | -                | <b>0,00</b>                  |  |                          |         |                   |                              |
| <b>SUMME AKTIEN</b>                                |                          |         | -                | <b>0,00</b>                  |  |                          |         |                   |                              |

\* Aufgrund der Marktgegebenheiten infolge der Ukraine- und Russland-Krise seit dem 25. Februar 2022 haben der Ausschuss für die Preisbestimmung und die Verwaltungsgesellschaft vereinbart und veranlasst, dass alle auf Rubel lautenden russischen Aktien im Anlageportfolio auf null abgeschrieben werden.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Managed Solutions – Asia Focused Conservative  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|----------|------------------------------|---|--------------------------|---------|----------|------------------------------|
| <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>  |                          |         |          |                              | <b>HONGKONG</b>   |                          |         |          |                              |
| <b>AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE<br/>WERTPAPIERE</b> |                          |         |          |                              | AIA GROUP 2,7 % VRN PERP                                  |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |          |                              | AIA GROUP 3,2 % 16.09.2040                                |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |          |                              | BANK OF EAST ASIA<br>6,625 % VRN 13.03.27                 |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |          |                              | 250.000 USD 252.259 0,78                                  |                          |         |          |                              |
| <b>ANLEIHEN</b>   |                          |         |          |                              | CHINA CINDA FINANCE<br>4,4 % 09.03.27                     |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |          |                              | 200.000 USD 193.383 0,60                                  |                          |         |          |                              |
| <b>CHINA</b>  |                          |         |          |                              | CHINA OVERSEAS GRAND OCEANS<br>FINANCE 2,45 % 09.02.26    |                          |         |          |                              |
| ALIBABA GROUP HOLDING<br>4 % 06.12.37                                 |                          |         |          |                              | 200.000 USD 175.736 0,54                                  |                          |         |          |                              |
| 200.000 USD 174.309 0,54  |                          |         |          |                              | CHINA OVERSEAS VIII<br>3,05 % 27.11.29                    |                          |         |          |                              |
| ALIBABA GROUP HOLDING<br>4,2 % 06.12.47                               |                          |         |          |                              | 200.000 USD 175.508 0,54                                  |                          |         |          |                              |
| 200.000 USD 165.044 0,51  |                          |         |          |                              | CITIC 2,85 % 25.02.30                                     |                          |         |          |                              |
| CCBL CAYMAN 1,6 %<br>15.09.26   |                          |         |          |                              | 200.000 USD 177.612 0,55                                  |                          |         |          |                              |
| 200.000 USD 182.989 0,57  |                          |         |          |                              | CK HUTCHISON INTERNATIONAL<br>4,875 % 21.04.33            |                          |         |          |                              |
| CHINA MODERN DAIRY HOLDINGS<br>2,125 % 14.07.26                       |                          |         |          |                              | 200.000 USD 198.633 0,62                                  |                          |         |          |                              |
| 200.000 USD 181.499 0,56  |                          |         |          |                              | CMB INTERNATIONAL LEASING MANA-<br>GEMENT 2,75 % 12.08.30 |                          |         |          |                              |
| CNOOC FINANCE 5 % 02.05.2042<br>350.000 USD 347.007 1,07              |                          |         |          |                              | 200.000 USD 173.341 0,54                                  |                          |         |          |                              |
| CONTEMPORARY RUIDING<br>DEVELOPMENT 1,5 % 09.09.26                    |                          |         |          |                              | CNAC HK FINBRIDGE 3 %<br>22.09.30                         |                          |         |          |                              |
| 200.000 USD 182.460 0,57  |                          |         |          |                              | 200.000 USD 175.935 0,55                                  |                          |         |          |                              |
| HUARONG FINANCE 5,5 %<br>16.01.25                                     |                          |         |          |                              | HONG KONG (GOVT) 0,8 %<br>27.08.27                        |                          |         |          |                              |
| 200.000 USD 197.973 0,61  |                          |         |          |                              | 25.650.000 HKD 3.000.572 9,30                             |                          |         |          |                              |
| INDUSTRIAL AND COMMERCIAL BANK<br>OF CHINA 4,875 % 21.09.25           |                          |         |          |                              | HONGKONG LAND FINANCE<br>5,25 % 14.07.33                  |                          |         |          |                              |
| 200.000 USD 198.570 0,62  |                          |         |          |                              | 200.000 USD 198.793 0,62                                  |                          |         |          |                              |
| SF HOLDING INVESTMENT<br>2021 3,125 % 17.11.2031                      |                          |         |          |                              | HUARONG FINANCE 4,625 %<br>03/06/2026                     |                          |         |          |                              |
| 200.000 USD 175.411 0,54  |                          |         |          |                              | 200.000 USD 192.188 0,60                                  |                          |         |          |                              |
| TENCENT MUSIC ENTERTAINMENT<br>2,00 % 03.09.30                        |                          |         |          |                              | LENOVO 3,421 % 02.11.30                                   |                          |         |          |                              |
| 200.000 USD 164.329 0,51  |                          |         |          |                              | 200.000 USD 175.688 0,54                                  |                          |         |          |                              |
| YONGDA INVESTMENT 2,25 %<br>16.06.25                                  |                          |         |          |                              | NAN FUNG TREASURY<br>3,625 % 27.08.30                     |                          |         |          |                              |
| 200.000 USD 191.959 0,59  |                          |         |          |                              | 200.000 USD 173.815 0,54                                  |                          |         |          |                              |
| YUNDA HOLDING INVESTMENT<br>2,25 % 19.08.25                           |                          |         |          |                              | NANYANG COMMERCIAL BANK<br>3,8 % VRN 20.11.29             |                          |         |          |                              |
| 200.000 USD 189.327 0,59  |                          |         |          |                              | 250.000 USD 246.295 0,76                                  |                          |         |          |                              |
| ZHONGSHENG GROUP<br>HOLDINGS 3 % 13.01.26                             |                          |         |          |                              | SUN HUNG KAI PROPERTIES<br>CAPITAL 2,75 % 13.05.30        |                          |         |          |                              |
| 200.000 USD 187.512 0,58  |                          |         |          |                              | 200.000 USD 175.612 0,54                                  |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |          |                              | <b>6.172.251 19,13</b>                                    |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |          |                              | <b>2.538.389 7,86</b>                                     |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |          |                              | <b>INDIEN</b>   |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |          |                              | ICICI BANK DUBAI 4 %<br>18.03.26                          |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |          |                              | 200.000 USD 194.909 0,60                                  |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |          |                              | NTPC 4,5 % 19.03.28                                       |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |          |                              | 200.000 USD 195.936 0,62                                  |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |          |                              | POWER FINANCE 3,35 %<br>16.05.31                          |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |          |                              | 200.000 USD 174.134 0,54                                  |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |          |                              | REC 2,75 % 13.01.27                                       |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |          |                              | 200.000 USD 185.563 0,57                                  |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |          |                              | <b>750.542 2,33</b>                                       |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |          |                              | <b>INDONESIEN</b>   |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |          |                              | INDOFOOD CBP SUKSES<br>MAKMUR 3,398 % 09.06.31            |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |          |                              | 200.000 USD 174.126 0,54                                  |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |          |                              | <b>174.126 0,54</b>                                       |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |          |                              | <b>JAPAN</b>  |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |          |                              | MIZUHO FINANCIAL 5,579 %<br>26.05.35                      |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |          |                              | 200.000 USD 202.757 0,63                                  |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |          |                              | SUMITOMO MITSUI TRUST<br>5,35 % 07.03.34                  |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |          |                              | 200.000 USD 204.526 0,63                                  |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |          |                              | <b>407.283 1,26</b>                                       |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |          |                              | <b>1.334.574 4,13</b>                                     |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |          |                              |   |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |          |                              |   |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |          |                              |   |                          |         |          |                              |
|   |                          |         |          |                              |   |                          |         |          |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Managed Solutions – Asia Focused Conservative (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapiieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|--|--------------------------|---------|------------------|------------------------------|
| <b>NIEDERLANDE</b>  |                          |         |                   |                              | <b>AN EINEM ANDEREM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE, ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |                          |         |                  |                              |
| MINEJESA CAPITAL 5,625 %<br>10/08/2037                          | 200.000                  | USD     | 181.446           | 0,56                         | <b>ANLEIHEN</b>  |                          |         |                  |                              |
|   |                          |         | <b>181.446</b>    | <b>0,56</b>                  | <b>AUSTRALIEN</b>  |                          |         |                  |                              |
| <b>PHILIPPINEN</b>  |                          |         |                   |                              | <b>AUSTRALIEN NEW ZEALAND BANKING</b>  |                          |         |                  |                              |
| METROPOLITAN BANK<br>5,375 % 06.03.29                           | 200.000                  | USD     | 200.489           | 0,62                         | 2,95 % VRN 22.07.30  | 200.000                  | USD     | 192.225          | 0,60                         |
|   |                          |         | <b>200.489</b>    | <b>0,62</b>                  | CIMIC FINANCE 7 % 25.03.2034   | 43.000                   | USD     | 44.166           | 0,14                         |
| <b>SINGAPUR</b>   |                          |         |                   |                              | <b>COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA 5,837 % 13.03.34</b>                       |                          |         |                  |                              |
| BOC AVIATION 1,75 %<br>21.01.26                                 | 200.000                  | USD     | 187.534           | 0,58                         |  | 200.000                  | USD     | 201.288          | 0,62                         |
| DBS GROUP HOLDINGS 3,3 %<br>VRN PERP                            | 200.000                  | USD     | 195.150           | 0,60                         |  |                          |         | <b>437.679</b>   | <b>1,36</b>                  |
| LLPL CAPITAL 6,875 %<br>04/02/2039                              | 200.000                  | USD     | 154.285           | 0,48                         | <b>CHINA</b>   |                          |         |                  |                              |
| ONGC VIDESH VANKORNEFT<br>3,75 % 27.07.26                       | 200.000                  | USD     | 192.693           | 0,60                         | BAIDU 1,625 % 23.02.27   | 200.000                  | USD     | 181.500          | 0,56                         |
| OVERSEACHINESE BANKING<br>1,832 % VRN 10.09.30                  | 200.000                  | USD     | 189.226           | 0,59                         | CHINA CINDA FINANCE<br>4,25 % 23.04.25                                       | 200.000                  | USD     | 196.983          | 0,61                         |
|   |                          |         | <b>918.888</b>    | <b>2,85</b>                  | ENN ENERGY HOLDINGS<br>4,625 % 17.05.27                                      | 200.000                  | USD     | 196.246          | 0,61                         |
| <b>SÜDKOREA</b>   |                          |         |                   |                              | <b>MEITUAN DIANPING 3,05 %<br/>28.10.30</b>                                  |                          |         |                  |                              |
| GS CALTEX 5,375 %<br>07/08/2028                                 | 200.000                  | USD     | 200.811           | 0,62                         | SANDS CHINA 4,375 %<br>18.06.30  | 200.000                  | USD     | 171.659          | 0,53                         |
| HANA BANK 3,5 % VRN PERP  | 200.000                  | USD     | 187.612           | 0,58                         | TENCENT HOLDINGS 3,24 %<br>03/06/2050  | 200.000                  | USD     | 183.482          | 0,57                         |
| KODIT GLOBAL 3,619 %<br>27.05.25                                | 200.000                  | USD     | 195.951           | 0,61                         | TENCENT HOLDINGS 3,975 %<br>11/04/2029                                       | 450.000                  | USD     | 136.029          | 0,42                         |
| KOOKMIN BANK 4,35 % VRN<br>PERP                                 | 200.000                  | USD     | 198.785           | 0,62                         |  |                          |         | 428.011          | 1,32                         |
| POSCO 4,875 % 23.01.27  | 200.000                  | USD     | 197.612           | 0,61                         |  |                          |         | <b>1.493.910</b> | <b>4,62</b>                  |
| SHINHAN BANK 3,875 %<br>24.03.26                                | 200.000                  | USD     | 193.412           | 0,60                         | <b>HONGKONG</b>  |                          |         |                  |                              |
| SHINHAN CARD 5,5 %<br>12/03/2029                                | 200.000                  | USD     | 201.412           | 0,62                         | AIA GROUP 5,375 % 05.04.34   | 200.000                  | USD     | 200.260          | 0,62                         |
| SK HYNIX 5,5 % 16.01.29   | 200.000                  | USD     | 199.759           | 0,62                         |  |                          |         | <b>200.260</b>   | <b>0,62</b>                  |
|   |                          |         | <b>1.575.354</b>  | <b>4,88</b>                  | <b>INDIEN</b>  |                          |         |                  |                              |
| <b>THAILAND</b>   |                          |         |                   |                              | <b>HDFC BANK 5,196 %<br/>15.02.27</b>  |                          |         |                  |                              |
| BANGKOK BANK 3,466 % VRN<br>23.09.36                            | 200.000                  | USD     | 168.980           | 0,52                         | RELIANCE INDUSTRIES<br>3,667 % 30.11.27                                      | 250.000                  | USD     | 198.767          | 0,62                         |
| THAI OIL TREASURY CENTER<br>4,875 % 23.01.43                    | 200.000                  | USD     | 175.372           | 0,55                         |  |                          |         | 237.068          | 0,73                         |
|   |                          |         | <b>344.352</b>    | <b>1,07</b>                  |  |                          |         | <b>435.835</b>   | <b>1,35</b>                  |
| <b>USA</b>  |                          |         |                   |                              | <b>INDONESIEN</b>  |                          |         |                  |                              |
| HYUNDAI CAPITAL AMERICA<br>5,3 % 08.01.29                       | 100.000                  | USD     | 100.193           | 0,31                         | FREEPORT INDONESIA 6,2 %<br>14.04.52   | 200.000                  | USD     | 199.262          | 0,62                         |
|   |                          |         | <b>100.193</b>    | <b>0,31</b>                  |  |                          |         | <b>199.262</b>   | <b>0,62</b>                  |
| <b>SUMME ANLEIHEN</b>   |                          |         |                   |                              | <b>MACAU</b>   |                          |         |                  |                              |
| <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTEN WERTPAPIERE</b> |                          |         |                   |                              | <b>SANDS CHINA 5,4 %<br/>08/08/2028</b>                                      |                          |         |                  |                              |
| <b>WERTPAPIERE</b>  |                          |         |                   |                              |  |                          |         |                  |                              |
|   |                          |         | <b>14.697.887</b> | <b>45,54</b>                 |  | 200.000                  | USD     | 196.275          | 0,61                         |
|   |                          |         |                   |                              |  |                          |         | <b>196.275</b>   | <b>0,61</b>                  |
|   |                          |         |                   |                              | <b>SÜDKOREA</b>  |                          |         |                  |                              |
|   |                          |         |                   |                              | HYUNDAI CAPITAL<br>SERVICES 5,125 % 05.02.27                                 | 200.000                  | USD     | 198.641          | 0,62                         |
|   |                          |         |                   |                              |  |                          |         | <b>198.641</b>   | <b>0,62</b>                  |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



## Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Managed Solutions – Asia Focused Conservative (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|
| <b>USA</b>  |                          |         |                   |                              |
| SK BATTERY AMERICA<br>4,875 % 23.01.27  | 200.000                  | USD     | 198.290           | 0,61                         |
|   |                          |         | <b>198.290</b>    | <b>0,61</b>                  |
| <b>SUMME ANLEIHEN</b>   |                          |         | <b>3.360.152</b>  | <b>10,41</b>                 |
| <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN<br/>MARKT GEHANDELTEN ÜBERTRAGBAREN WERTPAPIERE<br/>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b> |                          |         | <b>3.360.152</b>  | <b>10,41</b>                 |
| <b>IRLAND</b>   |                          |         |                   |                              |
| HSBC MSCI INDONESIA<br>UCITS ETF  | 2.162                    | USD     | 178.668           | 0,55                         |
| HSBC MSCI KOREA ETF   | 3.473                    | USD     | 190.910           | 0,60                         |
|   |                          |         | <b>369.578</b>    | <b>1,15</b>                  |
| <b>LUXEMBURG</b>  |                          |         |                   |                              |
| HGIF ASIA EX JAPAN<br>EQUITY „ZD“   | 62.495                   | USD     | 3.885.633         | 12,04                        |
| HGIF ASIA HIGH YIELD<br>BOND INC  | 809.308                  | USD     | 4.298.236         | 13,32                        |
| HGIF ASIAN CURRENCY<br>BOND „ZD“  | 449.876                  | USD     | 3.275.098         | 10,15                        |
| HGIF GEM LOCAL CURRENCY<br>RATES „ZD“   | 83.809                   | USD     | 634.095           | 1,96                         |
| HGIF GLOBAL EMERGING<br>MARKETS BOND „ZQ“   | 76.620                   | USD     | 571.659           | 1,77                         |
| HGIF INDIA FIXED INCOME<br>„ZD“   | 67.728                   | USD     | 602.646           | 1,87                         |
| HGIF INDIA EQUITY<br>Z INC  | 923                      | USD     | 311.014           | 0,96                         |
|   |                          |         | <b>13.578.381</b> | <b>42,07</b>                 |
| <b>SUMME ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>  |                          |         | <b>13.947.959</b> | <b>43,22</b>                 |
| <b>SUMME WERTPAPIERANLAGEN</b>  |                          |         | <b>32.005.998</b> | <b>99,17</b>                 |
| <b>SONSTIGES NETTOVERMÖGEN</b>  |                          |         | <b>269.420</b>    | <b>0,83</b>                  |
| <b>GESAMTNETTOVERMÖGEN</b>  |                          |         | <b>32.275.418</b> | <b>100,00</b>                |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Managed Solutions – Asia Focused Growth

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl  | Währung | Kurswert         | % des Nettovermögens | Beschreibung  | Anzahl | Währung | Kurswert | % des Nettovermögens |
|---|---------|---------|------------------|----------------------|---|--------|---------|----------|----------------------|
| <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>  |         |         |                  |                      | <b>SINGAPUR</b>   |        |         |          |                      |
| <b>AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |         |         |                  |                      | DBS GROUP   |        |         |          |                      |
|   |         |         |                  |                      | SINGAPUR  |        |         |          |                      |
|   |         |         |                  |                      | TELEKOMMUNIKATION   |        |         |          |                      |
|   |         |         |                  |                      | <b>274.687</b>  |        |         |          |                      |
|   |         |         |                  |                      | <b>1,50</b>   |        |         |          |                      |
| <b>AKTIEN</b>   |         |         |                  |                      | <b>SÜDKOREA</b>   |        |         |          |                      |
| <b>CHINA</b>  |         |         |                  |                      | CLASSYS   |        |         |          |                      |
| ALIBABA GROUP HOLDING   | 31.100  | HKD     | 279.153          | 1,52                 | 2.422   | KRW    | 63.867  | 0,35     |                      |
| BYD „H“   | 5.500   | HKD     | 141.673          | 0,77                 | 1.943   | KRW    | 342.055 | 1,86     |                      |
| CHINA CONSTRUCTION BANK „H“                                       | 435.000 | HKD     | 262.341          | 1,43                 | 4.114   | KRW    | 214.829 | 1,17     |                      |
| CHINA MERCHANTS BANK „H“  | 47.000  | HKD     | 185.863          | 1,01                 | 13.557  | KRW    | 813.672 | 4,43     |                      |
| CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOLOGY                                   | 880     | CNY     | 22.881           | 0,12                 | 2.970   | KRW    | 393.132 | 2,14     |                      |
| NETEASE   | 12.400  | HKD     | 257.936          | 1,41                 | 1.757   | KRW    | 102.581 | 0,56     |                      |
| PING AN INSURANCE „H“   | 29.500  | HKD     | 124.574          | 0,68                 | <b>1.930.136</b>  |        |         |          |                      |
| SHANGHAI SIYUAN ELECTRIC  | 19.400  | CNY     | 155.566          | 0,85                 | <b>10,51</b>  |        |         |          |                      |
| SHENZHEN MINDRAY BIO MEDICAL ELECTRONICS                          | 5.000   | CNY     | 192.751          | 1,05                 | <b>TAIWAN</b>   |        |         |          |                      |
| TENCENT HOLDINGS  | 19.900  | HKD     | 772.460          | 4,21                 | ALCHIP TECHNOLOGIES   |        |         |          |                      |
| TRIP COM GROUP  | 4.250   | HKD     | 187.454          | 1,02                 | LARGAN PRECISION  |        |         |          |                      |
| WEICHAI POWER   | 14.100  | CNY     | 31.675           | 0,17                 | MEDIATEK  |        |         |          |                      |
| WEICHAI POWER „H“   | 70.000  | HKD     | 133.445          | 0,73                 | QUANTA COMPUTER   |        |         |          |                      |
| ZHEJIANG SANHUA   | 4.300   | CNY     | 14.220           | 0,08                 | TAIWAN SEMICONDUCTOR  |        |         |          |                      |
| ZIJIN MINING GROUP „H“  | 92.000  | HKD     | 183.613          | 1,00                 | VERARBEITENDES GEWERBE  |        |         |          |                      |
|   |         |         | <b>2.945.605</b> | <b>16,05</b>         | UNIMICRON TECHNOLOGY  |        |         |          |                      |
|   |         |         |                  |                      | YAGEO CORP  |        |         |          |                      |
|   |         |         |                  |                      | <b>2.351.930</b>  |        |         |          |                      |
|   |         |         |                  |                      | <b>12,81</b>  |        |         |          |                      |
| <b>GROSSBRITANNIEN</b>  |         |         |                  |                      | <b>THAILAND</b>   |        |         |          |                      |
| XINYI SOLAR HOLDINGS  | 180.000 | HKD     | 139.374          | 0,76                 | BUMRUNGRAD HOSPITAL FOREIGN                                     |        |         |          |                      |
|   |         |         | <b>139.374</b>   | <b>0,76</b>          | PTT E&P   |        |         |          |                      |
|   |         |         |                  |                      | 18.900 THB  |        |         |          |                      |
|   |         |         |                  |                      | 35.400 THB  |        |         |          |                      |
|   |         |         |                  |                      | <b>260.070</b>  |        |         |          |                      |
|   |         |         |                  |                      | <b>1,42</b>   |        |         |          |                      |
| <b>HONGKONG</b>   |         |         |                  |                      | <b>SUMME AKTIEN</b>   |        |         |          |                      |
| AIA GROUP   | 49.400  | HKD     | 331.692          | 1,81                 | <b>11.165.918</b>   |        |         |          |                      |
| CHINA RESOURCES GAS GROUP   | 52.600  | HKD     | 167.684          | 0,91                 | <b>60,84</b>  |        |         |          |                      |
| HK EXCHANGES & CLEARING   | 2.200   | HKD     | 64.034           | 0,35                 |   |        |         |          |                      |
|   |         |         | <b>563.410</b>   | <b>3,07</b>          |   |        |         |          |                      |
| <b>INDIEN</b>   |         |         |                  |                      | <b>DEPOSITARY RECEIPTS</b>                                      |        |         |          |                      |
| APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE                                       | 816     | INR     | 62.194           | 0,34                 | <b>CHINA</b>  |        |         |          |                      |
| BHARTI AIRTEL   | 18.570  | INR     | 273.554          | 1,49                 | PINDUODUO   |        |         |          |                      |
| DLF   | 18.735  | INR     | 201.496          | 1,10                 | 2.070 USD   |        |         |          |                      |
| EICHER MOTORS   | 1.136   | INR     | 54.746           | 0,30                 | TENCENT MUSIC   |        |         |          |                      |
| HINDUSTAN UNILEVER  | 3.097   | INR     | 84.083           | 0,46                 | ENTERTAINMENT GROUP   |        |         |          |                      |
| ICICI BANK  | 24.320  | INR     | 318.804          | 1,74                 | <b>357.982</b>  |        |         |          |                      |
| INFOSYS   | 15.559  | INR     | 279.466          | 1,52                 | <b>1,95</b>   |        |         |          |                      |
| MANKIND PHARMA  | 3.910   | INR     | 107.862          | 0,59                 | <b>SUMME DEPOSITARY RECEIPTS</b>                                |        |         |          |                      |
| RELIANCE INDUSTRIES   | 12.984  | INR     | 462.631          | 2,52                 | <b>357.982</b>  |        |         |          |                      |
| SHRIRAM TRANSPORT FINANCE   | 10.269  | INR     | 290.552          | 1,58                 | <b>1,95</b>   |        |         |          |                      |
| ZOMATO  | 106.574 | INR     | 232.692          | 1,27                 |   |        |         |          |                      |
|   |         |         | <b>2.368.080</b> | <b>12,91</b>         |   |        |         |          |                      |
| <b>INDONESIEN</b>   |         |         |                  |                      | <b>VORZUGSAKTIEN</b>  |        |         |          |                      |
| BANK RAKYAT INDONESIA   | 871.700 | IDR     | 332.626          | 1,81                 | <b>SÜDKOREA</b>   |        |         |          |                      |
|   |         |         | <b>332.626</b>   | <b>1,81</b>          | SAMSUNG ELECTRONICS   |        |         |          |                      |
|   |         |         |                  |                      | 1.600 KRW   |        |         |          |                      |
|   |         |         |                  |                      | 79.866  |        |         |          |                      |
|   |         |         |                  |                      | <b>79.866</b>   |        |         |          |                      |
|   |         |         |                  |                      | <b>0,44</b>   |        |         |          |                      |
|   |         |         |                  |                      | <b>SUMME VORZUGSAKTIEN</b>                                      |        |         |          |                      |
|   |         |         |                  |                      | <b>79.866</b>   |        |         |          |                      |
|   |         |         |                  |                      | <b>0,44</b>   |        |         |          |                      |
|   |         |         |                  |                      | <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTEN WERTPAPIERE</b> |        |         |          |                      |
|   |         |         |                  |                      | <b>11.603.766</b>   |        |         |          |                      |
|   |         |         |                  |                      | <b>63,23</b>  |        |         |          |                      |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Managed Solutions – Asia Focused Growth (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl  | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|---------|---------|-------------------|------------------------------|
| <b>AN EINEM ANDEREM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE, ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>    |         |         |                   |                              |
| <b>AKTIEN</b>   |         |         |                   |                              |
| <b>TAIWAN</b>   |         |         |                   |                              |
| E INK HOLDINGS  | 13.000  | TWD     | 92.209            | 0,50                         |
|   |         |         | <b>92.209</b>     | <b>0,50</b>                  |
| <b>SUMME AKTIEN</b>   |         |         | <b>92.209</b>     | <b>0,50</b>                  |
| <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN MARKT GEHANDELTEN ÜBERTRAGBAREN WERTPAPIERE</b> |         |         | <b>92.209</b>     | <b>0,50</b>                  |
| <b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>  |         |         |                   |                              |
| <b>IRLAND</b>   |         |         |                   |                              |
| HSBC MSCI INDONESIA UCITS ETF   | 2.225   | USD     | 183.874           | 1,00                         |
| HSBC MSCI KOREA ETF   | 3.141   | USD     | 172.661           | 0,94                         |
|   |         |         | <b>356.535</b>    | <b>1,94</b>                  |
| <b>LUXEMBURG</b>  |         |         |                   |                              |
| HGIF ASIA HIGH YIELD BOND INC   | 540.040 | USD     | 2.868.152         | 15,62                        |
| HGIF ASIAN CURRENCY BOND „ZD“   | 253.045 | USD     | 1.842.167         | 10,04                        |
| HGIF GEM LOCAL CURRENCY RATES „ZD“  | 24.476  | USD     | 185.184           | 1,01                         |
| HGIF GLOBAL EMERGING MARKETS BOND „ZQ“  | 62.897  | USD     | 469.273           | 2,56                         |
| HGIF INDIA FIXED INCOME „ZD“  | 32.825  | USD     | 292.081           | 1,59                         |
| HGIF INDIA EQUITY Z INC   | 772     | USD     | 260.058           | 1,42                         |
|   |         |         | <b>5.916.915</b>  | <b>32,24</b>                 |
| <b>SUMME ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>                                  |         |         | <b>6.273.450</b>  | <b>34,18</b>                 |
| <b>SUMME WERTPAPIERANLAGEN</b>  |         |         | <b>17.969.425</b> | <b>97,91</b>                 |
| <b>SONSTIGES NETTOVERMÖGEN</b>  |         |         | <b>384.343</b>    | <b>2,09</b>                  |
| <b>GESAMTNETTOVERMÖGEN</b>  |         |         | <b>18.353.768</b> | <b>100,00</b>                |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Managed Solutions – Asia Focused Income

Aufstellung der Wertpapierranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung                                      | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|---|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|
| <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>  |                          |         |                   |                              | <b>HYUNDAI MOTOR</b>                              |                          |         |                   |                              |
| <b>AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |                          |         |                   |                              | <b>KB FINANCIAL GROUP</b>                         |                          |         |                   |                              |
| <b>AKTIEN</b>   |                          |         |                   |                              | <b>SAMSUNG ELECTRONICS</b>                        |                          |         |                   |                              |
| <b>AUSTRALIEN</b>   |                          |         |                   |                              | <b>SK SQUARE</b>                                  |                          |         |                   |                              |
| BHP BILLITON  | 97.569                   | AUD     | 2.817.963         | 1,02                         | SK TELECOM  | 58.466                   | KRW     | 2.314.754         | 0,83                         |
| NATIONAL AUSTRALIA BANK   | 73.478                   | AUD     | 1.660.539         | 0,60                         |   |                          |         | <b>13.510.078</b> | <b>4,87</b>                  |
| SANTOS  | 751.164                  | AUD     | 3.797.961         | 1,36                         | <b>TAIWAN</b>                                     |                          |         |                   |                              |
| SOUTH32   | 1.589.155                | AUD     | 3.110.294         | 1,12                         | ASE TECHNOLOGY HOLDING                            | 101.000                  | TWD     | 489.165           | 0,18                         |
| TELSTRA CORP  | 889.732                  | AUD     | 2.240.580         | 0,81                         | CHROMA ATE  | 115.000                  | TWD     | 907.323           | 0,33                         |
|   |                          |         | <b>13.627.337</b> | <b>4,91</b>                  | MEDIATEK  | 70.000                   | TWD     | 2.537.222         | 0,91                         |
| <b>CHINA</b>  |                          |         |                   |                              | QUANTA COMPUTER                                   | 171.000                  | TWD     | 1.496.086         | 0,54                         |
| ALIBABA GROUP HOLDING   | 236.000                  | HKD     | 2.118.330         | 0,76                         | TAIWAN SEMICONDUCTOR                              |                          |         |                   |                              |
| BAIDU   | 333.700                  | HKD     | 4.378.867         | 1,58                         | VERARBEITENDES GEWERBE                            | 365.000                  | TWD     | 8.770.447         | 3,16                         |
| CHINA STATE CONSTRUCTION INTERNATIONAL                            | 2.290.000                | HKD     | 2.498.783         | 0,90                         | UNIMICRON TECHNOLOGY                              | 147.000                  | TWD     | 872.717           | 0,31                         |
| PING AN INSURANCE „H“   | 823.000                  | HKD     | 3.475.413         | 1,25                         | UNITED MICRO ELECTRONICS                          | 953.000                  | TWD     | 1.548.456         | 0,56                         |
| TINGYI  | 3.082.000                | HKD     | 3.378.743         | 1,22                         |   |                          |         | <b>16.621.416</b> | <b>5,99</b>                  |
| UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS                                      | 3.785.000                | HKD     | 2.693.744         | 0,97                         | <b>SUMME AKTIEN</b>                               |                          |         |                   |                              |
|   |                          |         | <b>18.543.880</b> | <b>6,68</b>                  |   |                          |         | <b>82.374.970</b> | <b>29,68</b>                 |
| <b>HONGKONG</b>   |                          |         |                   |                              | <b>ANLEIHEN</b>                                   |                          |         |                   |                              |
| AIA GROUP   | 342.600                  | HKD     | 2.300.357         | 0,83                         | <b>AUSTRALIEN</b>                                 |                          |         |                   |                              |
| HK EXCHANGES & CLEARING   | 61.900                   | HKD     | 1.801.688         | 0,65                         | NICKEL INDUSTRIES                                 |                          |         |                   |                              |
|   |                          |         | <b>4.102.045</b>  | <b>1,48</b>                  | 11,25 % 21.10.28                                  | 200.000                  | USD     | 215.203           | 0,08                         |
| <b>INDIEN</b>   |                          |         |                   |                              | WESTPAC BANKING 2,894 %                           |                          |         |                   |                              |
| HDFC BANK   | 12.914                   | INR     | 224.192           | 0,08                         | VRN 04.02.30                                      | 400.000                  | USD     | 389.311           | 0,14                         |
| INFOSYS   | 114.917                  | INR     | 2.064.103         | 0,75                         |   |                          |         | <b>604.514</b>    | <b>0,22</b>                  |
| POWER FINANCIAL (INE134E01011)                                    | 234.061                  | INR     | 1.095.199         | 0,39                         | <b>KANADA</b>                                     |                          |         |                   |                              |
| TECH MAHINDRA   | 45.038                   | INR     | 673.984           | 0,24                         | NEXEN 6,4 % 15.05.37                              | 1.000.000                | USD     | 1.125.615         | 0,41                         |
|   |                          |         | <b>4.057.478</b>  | <b>1,46</b>                  | NEXEN 7,5 % 30.07.39                              | 1.100.000                | USD     | 1.365.915         | 0,49                         |
| <b>INDONESIEN</b>   |                          |         |                   |                              |   |                          |         | <b>2.491.530</b>  | <b>0,90</b>                  |
| AKR CORPORINDO  | 8.179.700                | IDR     | 887.359           | 0,32                         | <b>CHINA</b>                                      |                          |         |                   |                              |
| BANK NEGARA INDONESIA TELEKOMUNIKASI                              | 2.317.700                | IDR     | 862.468           | 0,31                         | ALIBABA GROUP HOLDING                             |                          |         |                   |                              |
| INDONESIA PERSERO „B“   | 11.495.200               | IDR     | 2.515.822         | 0,91                         | 3,4 % 06.12.27                                    | 1.500.000                | USD     | 1.420.923         | 0,51                         |
|   |                          |         | <b>4.265.649</b>  | <b>1,54</b>                  | ALIBABA GROUP HOLDING                             |                          |         |                   |                              |
| <b>LUXEMBURG</b>  |                          |         |                   |                              | 4 % 06.12.37                                      | 600.000                  | USD     | 522.928           | 0,19                         |
| L'OCCITANE INTERNATIONAL  | 894.250                  | HKD     | 3.616.328         | 1,30                         | ALIBABA GROUP HOLDING                             |                          |         |                   |                              |
|   |                          |         | <b>3.616.328</b>  | <b>1,30</b>                  | 4,2 % 06.12.47                                    | 1.000.000                | USD     | 825.222           | 0,30                         |
| <b>SINGAPUR</b>   |                          |         |                   |                              | BAIDU 1,72 % 09.04.26                             | 600.000                  | USD     | 559.455           | 0,20                         |
| DBS GROUP SINGAPUR  | 85.700                   | SGD     | 2.287.916         | 0,82                         | CHALCO HONG KONG INVESTMENT                       |                          |         |                   |                              |
| TELEKOMMUNIKATION   | 929.700                  | SGD     | 1.742.843         | 0,63                         | 2,1 % 28.07.26                                    | 740.000                  | USD     | 687.490           | 0,25                         |
|   |                          |         | <b>4.030.759</b>  | <b>1,45</b>                  | CHINA MODERN DAIRY HOLDINGS                       |                          |         |                   |                              |
| <b>SÜDKOREA</b>   |                          |         |                   |                              | 2,125 % 14.07.26                                  | 1.000.000                | USD     | 907.496           | 0,33                         |
| HYUNDAI MARINE & FIRE INSURANCE                                   | 114.761                  | KRW     | 2.629.806         | 0,95                         | CNOOC FINANCE 5 %                                 |                          |         |                   |                              |
|   |                          |         |                   |                              | 02/05/2042  | 500.000                  | USD     | 495.724           | 0,18                         |
|   |                          |         |                   |                              | CONTEMPORARY RUIDING DEVELOPMENT 1,875 % 17.09.25 | 600.000                  | USD     | 569.713           | 0,21                         |
|   |                          |         |                   |                              | 21.09.26  | 450.000                  | USD     | 397.760           | 0,14                         |
|   |                          |         |                   |                              | 21.09.26  | 450.000                  | USD     | 397.760           | 0,14                         |
|   |                          |         |                   |                              | 21.09.26  | 450.000                  | USD     | 397.760           | 0,14                         |
|   |                          |         |                   |                              | 14.11.24  | 225.000                  | USD     | 225.744           | 0,08                         |
|   |                          |         |                   |                              | ENN CLEAN ENERGY INTERNATIONAL 3,375 %            |                          |         |                   |                              |
|   |                          |         |                   |                              | 12/05/2026  | 300.000                  | USD     | 284.318           | 0,10                         |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Managed Solutions – Asia Focused Income (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapiieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert  | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung                                   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|-----------|------------------------------|--|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|
| GREENTOWN CHINA<br>HOLDINGS 4,7 % 29.04.25                  | 200.000                  | USD     | 186.749   | 0,07                         | WYNN MACAU 5,5 %<br>01/10/2027                 | 200.000                  | USD     | 191.557           | 0,07                         |
| HUARONG FINANCE 5,5 %<br>16.01.25                           | 200.000                  | USD     | 197.973   | 0,07                         | YONGDA INVESTMENT 2,25 %<br>16.06.25           | 900.000                  | USD     | 863.815           | 0,31                         |
| INDUSTRIAL COMMERCIAL BANK<br>OF CHINA 3,2 % VRN PERP       | 1.550.000                | USD     | 1.471.758 | 0,53                         | YUNDA HOLDING INVESTMENT<br>2,25 % 19.08.25    | 1.150.000                | USD     | 1.088.630         | 0,39                         |
| INDUSTRIAL AND COMMERCIAL BANK<br>OF CHINA 4,875 % 21.09.25 | 2.000.000                | USD     | 1.985.695 | 0,72                         | ZHONGSHENG GROUP<br>HOLDINGS 3 % 13.01.26      | 1.116.000                | USD     | 1.046.317         | 0,38                         |
| INVENTIVE GLOBAL INVESTMENTS<br>1,65 % 03.09.25             | 800.000                  | USD     | 756.801   | 0,27                         |  |                          |         | <b>19.182.606</b> | <b>6,92</b>                  |
| LONGFOR GROUP HOLDINGS<br>3,95 % 16.09.29                   | 280.000                  | USD     | 147.513   | 0,05                         | <b>GROSSBRITANNIEN</b>                         |                          |         |                   |                              |
| LONGFOR PROPERTIES 4,5 %<br>16.01.28                        | 550.000                  | USD     | 338.681   | 0,12                         | PRUDENTIAL 2,95 % VRN<br>03/11/2033            | 1.300.000                | USD     | 1.156.655         | 0,42                         |
| MODERN LAND CHINA 2 %<br>28.12.24                           | 200.196                  | USD     | 1.964     | 0,00                         | STANDARD CHARTERED<br>2,678 % VRN 29.06.32     | 1.100.000                | USD     | 905.626           | 0,33                         |
| MODERN LAND CHINA 9 %<br>30.12.26                           | 254.146                  | USD     | 4.864     | 0,00                         | STANDARD CHARTERED<br>3,265 % VRN 18.02.36     | 1.545.000                | USD     | 1.297.967         | 0,47                         |
| MODERN LAND CHINA 9 %<br>30.12.27                           | 408.189                  | USD     | 7.587     | 0,00                         | STANDARD CHARTERED<br>4,866 % VRN 15.03.33     | 800.000                  | USD     | 762.416           | 0,27                         |
| NEW METRO GLOBAL 4,8 %<br>15.12.24                          | 400.000                  | USD     | 212.132   | 0,08                         | STANDARD CHARTERED<br>6,301 % VRN 09.01.29     | 1.452.000                | USD     | 1.493.729         | 0,54                         |
| SF HOLDING INVESTMENT<br>2,875 % 20.02.30                   | 600.000                  | USD     | 532.069   | 0,19                         | STANDARD CHARTERED<br>7,018 % 08.02.30         | 800.000                  | USD     | 848.431           | 0,31                         |
| SF HOLDING INVESTMENT<br>3,125 % 17.11.31                   | 500.000                  | USD     | 438.529   | 0,16                         | STANDARD CHARTERED FRN<br>08/02/2028           | 650.000                  | USD     | 662.953           | 0,24                         |
| SINOPEC GROUP OVERSEAS<br>4,875 % 17.05.42                  | 400.000                  | USD     | 391.277   | 0,14                         | STANDARD CHARTERED PLC<br>6,187 % VRN 06.07.27 | 408.000                  | USD     | 412.295           | 0,15                         |
| SUNAC CHINA HOLDINGS<br>6,5 % 30.09.27                      | 509.265                  | USD     | 48.713    | 0,02                         | VEDANTA RESOURCES<br>6,125 % 09.08.24          | 350.000                  | USD     | 289.942           | 0,10                         |
| SUNAC CHINA HOLDINGS<br>6,75 % 30.09.28                     | 199.254                  | USD     | 16.439    | 0,01                         | VEDANTA RESOURCES<br>FINANCE 9,25 % 23.04.26   | 200.000                  | USD     | 163.501           | 0,06                         |
| SUNAC CHINA HOLDINGS 7 %<br>30.09.29                        | 213.312                  | USD     | 16.146    | 0,01                         | VEDANTA RESOURCES<br>FINANCE 13,875 % 21.01.27 | 655.000                  | USD     | 290.887           | 0,10                         |
| SUNAC CHINA HOLDINGS<br>7,25 % 30.09.30                     | 231.234                  | USD     | 16.031    | 0,01                         |  |                          |         | <b>8.284.402</b>  | <b>2,99</b>                  |
| TENCENT HOLDINGS 3,925 %<br>19.01.38                        | 220.000                  | USD     | 189.481   | 0,07                         | <b>HONGKONG</b>                                |                          |         |                   |                              |
| TENCENT HOLDINGS 3,94 %<br>22.04.61                         | 200.000                  | USD     | 149.100   | 0,05                         | AIA GROUP 2,7 % VRN PERP                       | 732.000                  | USD     | 683.790           | 0,25                         |
| TENCENT MUSIC ENTERTAINMENT<br>2,00 % 03.09.30              | 1.400.000                | USD     | 1.150.301 | 0,41                         | AIA GROUP 3,2 % 16.09.2040                     | 2.200.000                | USD     | 1.650.292         | 0,59                         |
| WEST CHINA CEMENT 4,95 %<br>08/07/2026                      | 450.000                  | USD     | 379.502   | 0,14                         | BANK OF EAST ASIA<br>4 % VRN 29.05.30          | 1.000.000                | USD     | 969.369           | 0,35                         |
| WYNN MACAU 5,125 %<br>15.12.29                              | 500.000                  | USD     | 456.209   | 0,16                         | BANK OF EAST ASIA<br>6,625 % VRN 13.03.27      | 250.000                  | USD     | 252.259           | 0,09                         |
|   |                          |         |           |                              | BANK OF EAST ASIA<br>6,75 % VRN 15.03.27       | 500.000                  | USD     | 504.877           | 0,18                         |
|   |                          |         |           |                              | CAS CAPITAL 4 % VRN PERP                       | 550.000                  | USD     | 503.903           | 0,18                         |
|   |                          |         |           |                              | CENTRAL PLAZA DEVELOPMENT<br>4,65 % 19.01.26   | 200.000                  | USD     | 176.223           | 0,06                         |
|   |                          |         |           |                              | CHAMPION PATH HOLDINGS<br>4,85 % 27.01.28      | 200.000                  | USD     | 182.251           | 0,07                         |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Managed Solutions – Asia Focused Income (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert  | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung               | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--------------------------|---------|-----------|------------------------------|----------------------------|--------------------------|---------|-----------|------------------------------|
| CHARMING LIGHT INVESTMENTS                                 |                          |         |           |                              | HUARONG FINANCE 4,25 %     |                          |         |           |                              |
| 4,375 % 21.12.27   | 300.000                  | USD     | 286.903   | 0,10                         | 07/11/2027                 | 200.000                  | USD     | 184.940   | 0,07                         |
| CHINA CINDA FINANCE  |                          |         |           |                              | HUARONG FINANCE 4,25 %     |                          |         |           |                              |
| 4,4 % 09.03.27   | 500.000                  | USD     | 483.457   | 0,17                         | VRN PERP                   | 400.000                  | USD     | 384.828   | 0,14                         |
| CHINA CINDA FINANCE  |                          |         |           |                              | HUARONG FINANCE 4,5 %      |                          |         |           |                              |
| 4,75 % 08.02.28  | 500.000                  | USD     | 487.047   | 0,18                         | 29.05.29                   | 200.000                  | USD     | 182.689   | 0,07                         |
| CHINA OVERSEA FINANCE                                      |                          |         |           |                              | HUARONG FINANCE 4,625 %    |                          |         |           |                              |
| 6,375 % 29.10.43   | 225.000                  | USD     | 218.691   | 0,08                         | 03/06/2026                 | 1.000.000                | USD     | 960.939   | 0,35                         |
| CHINA OVERSEAS GRAND OCEANS                                |                          |         |           |                              | HUTCHINSON WHAM 7,45 %     |                          |         |           |                              |
| FINANCE 2,45 % 09.02.26                                    | 236.000                  | USD     | 207.369   | 0,07                         | 24.11.33                   | 300.000                  | USD     | 351.653   | 0,13                         |
| CHINA OVERSEAS VIII  |                          |         |           |                              | LAI SUN 5 % 28.07.2026     | 400.000                  | USD     | 243.610   | 0,09                         |
| 3,05 % 27.11.29  | 680.000                  | USD     | 596.727   | 0,22                         | LENOVO 3,421 % 02.11.30    | 600.000                  | USD     | 527.064   | 0,19                         |
| CITIC 2,875 % 17.02.27                                     | 500.000                  | USD     | 471.470   | 0,17                         | LINK FINANCE 2,75 %        |                          |         |           |                              |
| CK HUTCHISON INTERNATIONAL                                 |                          |         |           |                              | 19.01.32                   | 300.000                  | USD     | 254.688   | 0,09                         |
| 4,75 % 21.04.28  | 635.000                  | USD     | 630.648   | 0,23                         | LS FINANCE 4,8 %           |                          |         |           |                              |
| CK HUTCHISON INTERNATIONAL                                 |                          |         |           |                              | 18.06.26                   | 200.000                  | USD     | 176.747   | 0,06                         |
| 4,875 % 21.04.33   | 250.000                  | USD     | 248.291   | 0,09                         | MELCO RESORTS FINANCE      |                          |         |           |                              |
| CMB INTERNATIONAL LEASING MANA-<br>GEMENT 1,875 % 12.08.25 | 400.000                  | USD     | 380.744   | 0,14                         | 4,875 % 06.06.25           | 200.000                  | USD     | 195.373   | 0,07                         |
| CMB INTERNATIONAL LEASING MANA-<br>GEMENT 2,75 % 12.08.30  | 900.000                  | USD     | 780.036   | 0,28                         | MELCO RESORTS FINANCE      |                          |         |           |                              |
| CNAC HK FINBRIDGE 3 %                                      |                          |         |           |                              | 5,25 % 26.04.26            | 210.000                  | USD     | 202.637   | 0,07                         |
| 22.09.30   | 800.000                  | USD     | 703.740   | 0,25                         | MELCO RESORTS FINANCE      |                          |         |           |                              |
| CNAC HK FINBRIDGE  |                          |         |           |                              | 5,375 % 04.12.29           | 200.000                  | USD     | 182.858   | 0,07                         |
| 4,875 % 14.03.25   | 400.000                  | USD     | 397.185   | 0,14                         | MELCO RESORTS FINANCE      |                          |         |           |                              |
| ELECT GLOBAL INVESTMENTS                                   |                          |         |           |                              | 5,625 % 17.07.27           | 250.000                  | USD     | 239.316   | 0,09                         |
| 4,10 % VRN PERP  | 400.000                  | USD     | 365.013   | 0,13                         | MELCO RESORTS FINANCE      |                          |         |           |                              |
| FEC FINANCE 7,375 % VRN                                    |                          |         |           |                              | 5,75 % 21.07.28            | 600.000                  | USD     | 568.386   | 0,20                         |
| PERP   | 200.000                  | USD     | 194.568   | 0,07                         | NAN FUNG TREASURY          |                          |         |           |                              |
| FORTUNE STAR 5 %   |                          |         |           |                              | 3,625 % 27.08.30           | 400.000                  | USD     | 347.631   | 0,13                         |
| 18.05.26   | 600.000                  | USD     | 517.478   | 0,19                         | NAN FUNG TREASURY          |                          |         |           |                              |
| FORTUNE STAR 5,05 %  |                          |         |           |                              | 3,875 % 03.10.27           | 300.000                  | USD     | 277.690   | 0,10                         |
| 27.01.27   | 235.000                  | USD     | 191.918   | 0,07                         | NANYANG COMMERCIAL BANK    |                          |         |           |                              |
| FORTUNE STAR 5,95 %  |                          |         |           |                              | 3,8 % VRN 20.11.29         | 1.286.000                | USD     | 1.266.940 | 0,46                         |
| 19.10.25   | 400.000                  | USD     | 366.629   | 0,13                         | NANYANG COMMERCIAL BANK    |                          |         |           |                              |
| GLP CHINA HOLDINGS   |                          |         |           |                              | 6,5 % VRN PERP             | 250.000                  | USD     | 251.984   | 0,09                         |
| 2,95 % 29.03.26  | 415.000                  | USD     | 335.832   | 0,12                         | NWD FINANCE 4,125 % VRN    |                          |         |           |                              |
| HKT CAPITAL 3 % 18.01.2032                                 | 311.000                  | USD     | 269.211   | 0,10                         | PERP                       | 400.000                  | USD     | 235.033   | 0,08                         |
| HKT CAPITAL NO 4   |                          |         |           |                              | NWD FINANCE 5,25 % VRN     |                          |         |           |                              |
| 3 % 14.07.26   | 1.200.000                | USD     | 1.140.344 | 0,41                         | PERP                       | 200.000                  | USD     | 145.169   | 0,05                         |
| HONGKONG ELECTRIC  |                          |         |           |                              | NWD FINANCE 6,15 % VRN     |                          |         |           |                              |
| FINANCE 2,25 % 09.06.30                                    | 400.000                  | USD     | 344.536   | 0,12                         | PERP                       | 850.000                  | USD     | 749.769   | 0,27                         |
| HONGKONG LAND FINANCE                                      |                          |         |           |                              | NWD FINANCE 6,25 % PERP    | 400.000                  | USD     | 221.369   | 0,08                         |
| 2,25 % 15.07.31  | 600.000                  | USD     | 492.308   | 0,18                         | NWD MTN 4,125 % 18.07.2029 | 700.000                  | USD     | 537.651   | 0,19                         |
| HONGKONG LAND FINANCE                                      |                          |         |           |                              | PINGAN REAL ESTATE         |                          |         |           |                              |
| 5,25 % 14.07.33  | 226.000                  | USD     | 224.636   | 0,08                         | CAPITAL 3,45 % 29.07.26    | 200.000                  | USD     | 166.843   | 0,06                         |
| HOPSON DEVELOPMENT   |                          |         |           |                              | RKPF OVERSEAS 6,7 %        |                          |         |           |                              |
| HOLDINGS 7 % 18.05.24                                      | 230.000                  | USD     | 222.536   | 0,08                         | 30.09.24                   | 200.000                  | USD     | 124.576   | 0,04                         |
| HUARONG FINANCE 2017                                       |                          |         |           |                              | SHANGHAI COMMERCIAL BANK   |                          |         |           |                              |
| 4,75 % 27.04.27  | 370.000                  | USD     | 351.384   | 0,13                         | 6,375 % VRN 28.02.33       | 500.000                  | USD     | 505.958   | 0,18                         |
|  |                          |         |           |                              | SHANGHAI PORT GROUP        |                          |         |           |                              |
|  |                          |         |           |                              | DEVELOPMENT 2,375 %        |                          |         |           |                              |
|  |                          |         |           |                              | 13.07.30                   | 500.000                  | USD     | 435.528   | 0,16                         |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Managed Solutions – Asia Focused Income (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung                                       | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung                                   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|--|--------------------------|---------|----------|------------------------------|
| SHUI ON DEVELOPMENT<br>HOLDING 6,15 % 24.08.24     | 200.000                  | USD     | 176.348           | 0,06                         | INDOFOOD CBP SUKSES<br>MAKMUR 3,541 % 27.04.32 | 418.000                  | USD     | 361.424  | 0,13                         |
| STUDIO CITY FINANCE 5 %<br>15.01.29                | 400.000                  | USD     | 352.578           | 0,13                         | INDOFOOD CBP SUKSES<br>MAKMUR 4,745 % 09.06.51 | 300.000                  | USD     | 245.257  | 0,09                         |
| STUDIO CITY FINANCE<br>6,5 % 15.01.28              | 300.000                  | USD     | 286.085           | 0,10                         | INDOFOOD CBP SUKSES<br>MAKMUR 4,805 % 27.04.52 | 225.000                  | USD     | 184.779  | 0,07                         |
| SUN HUNG KAI PROPERTIES<br>CAPITAL 3,75 % 25.02.29 | 500.000                  | USD     | 471.741           | 0,17                         | INDONESIA (GOVT) 5,125 %<br>15.04.27           | 1.000.000.000            | IDR     | 60.845   | 0,02                         |
| YANGO JUSTICE INTERNATIONAL<br>8,25 % 25.11.23*    | 470.000                  | USD     | 3.072             | 0,00                         | INDONESIA (GOVT) 5,5 %<br>15.04.26             | 5.000.000.000            | IDR     | 310.455  | 0,11                         |
| YANLORD LAND 5,125 %<br>20.05.26                   | 400.000                  | USD     | 319.745           | 0,12                         | INDONESIA (GOVT) 6,125 %<br>15.05.28           | 2.000.000.000            | IDR     | 124.320  | 0,04                         |
|  |                          |         | <b>27.363.103</b> | <b>9,86</b>                  | INDONESIA (GOVT) 6,25 %<br>15.06.36            | 1.700.000.000            | IDR     | 103.855  | 0,04                         |
| <b>INDIEN</b>                                      |                          |         |                   |                              | INDONESIA (GOVT) 6,375 %<br>15.08.28           | 2.000.000.000            | IDR     | 125.894  | 0,05                         |
| AXIS BANK 4,1 % VRN PERP                           | 200.000                  | USD     | 186.004           | 0,07                         | INDONESIA (GOVT) 6,375 %<br>15.04.32           | 2.000.000.000            | IDR     | 124.660  | 0,04                         |
| DELHI INTERNATIONAL<br>AIRPORT 6,45 % 04.06.29     | 350.000                  | USD     | 345.824           | 0,12                         | INDONESIA (GOVT) 6,375 %<br>15.07.37           | 1.500.000.000            | IDR     | 92.444   | 0,03                         |
| HDFC BANK 5,686 %<br>02/03/2026                    | 358.000                  | USD     | 359.420           | 0,13                         | INDONESIA (GOVT) 6,5 %<br>15.02.31             | 500.000.000              | IDR     | 31.348   | 0,01                         |
| HPCL MITTAL ENERGY 5,45 %<br>22.10.26              | 220.000                  | USD     | 214.385           | 0,08                         | INDONESIA (GOVT) 6,625 %<br>15.05.33           | 3.500.000.000            | IDR     | 220.549  | 0,08                         |
| ICICI BANK DUBAI 4 %<br>18.03.26                   | 500.000                  | USD     | 487.272           | 0,18                         | INDONESIA (GOVT) 6,625 %<br>15.02.34           | 1.500.000.000            | IDR     | 94.428   | 0,03                         |
| INDIABULLS HOUSING<br>FINANCE 9,7 % 03.07.27       | 200.000                  | USD     | 200.074           | 0,07                         | INDONESIA (GOVT) 6,875 %<br>15.04.29           | 1.500.000.000            | IDR     | 95.868   | 0,03                         |
| JSW INFRASTRUCTURE<br>4,95 % 21.01.29              | 305.000                  | USD     | 286.913           | 0,10                         | INDONESIA (GOVT) 6,875 %<br>15.08.51           | 4.300.000.000            | IDR     | 269.799  | 0,10                         |
| POWER FINANCE 3,35 %<br>16.05.31                   | 1.000.000                | USD     | 870.669           | 0,31                         | INDONESIA (GOVT) 7 %<br>15.05.27               | 1.000.000.000            | IDR     | 64.049   | 0,02                         |
| REC 2,25 % 01.09.26                                | 579.000                  | USD     | 535.053           | 0,19                         | INDONESIA (GOVT) 7 %<br>15.09.30               | 2.000.000.000            | IDR     | 128.825  | 0,05                         |
| REC 2,75 % 13.01.27                                | 979.000                  | USD     | 908.328           | 0,34                         | INDONESIA (GOVT) 7 %<br>15.02.33               | 4.000.000.000            | IDR     | 258.322  | 0,09                         |
| REC 5,625 % 11.04.28                               | 287.000                  | USD     | 289.318           | 0,10                         | INDONESIA (GOVT) 7,125 %<br>15.06.38           | 2.000.000.000            | IDR     | 129.025  | 0,05                         |
| RENEW POWER 5,875 %<br>05/03/2027                  | 180.000                  | USD     | 175.953           | 0,06                         | INDONESIA (GOVT) 7,125 %<br>15.06.42           | 1.700.000.000            | IDR     | 109.479  | 0,04                         |
| STATE BANK OF INDIA LONDON<br>4,875 % 05.05.28     | 485.000                  | USD     | 481.176           | 0,17                         | INDONESIA (GOVT) 7,375 %<br>15.05.48           | 1.300.000.000            | IDR     | 86.317   | 0,03                         |
|  |                          |         | <b>5.340.389</b>  | <b>1,92</b>                  | INDONESIA (GOVT) 7,5 %<br>15.05.38             | 1.000.000.000            | IDR     | 66.716   | 0,02                         |
| <b>INDONESIEN</b>                                  |                          |         |                   |                              | INDONESIA (GOVT) 7,5 %<br>15.04.40             | 2.700.000.000            | IDR     | 180.317  | 0,06                         |
| ALAM SUTERA REALTY<br>6,25 % 02.11.25              | 150.000                  | USD     | 148.596           | 0,05                         | INDONESIA (GOVT) 7,5 %<br>15.08.32             | 1.000.000.000            | IDR     | 66.571   | 0,02                         |
| BANK NEGARA INDONESIA<br>4,3 % VRN PERP            | 450.000                  | USD     | 418.068           | 0,16                         |  |                          |         |          |                              |
| BUKIT MAKMUR MANDIRI<br>UTAMA 7,75 % 10.02.26      | 200.000                  | USD     | 199.416           | 0,07                         |  |                          |         |          |                              |
| GAJAH TUNGGAL 8,95 %<br>23.06.26                   | 200.000                  | USD     | 194.030           | 0,07                         |  |                          |         |          |                              |
| HYUNDAI MOTOR MANUFACTURING<br>1,75 % 06.05.26     | 400.000                  | USD     | 370.116           | 0,13                         |  |                          |         |          |                              |

\* Der Vermögenswert, der am 25. November 2023 fällig war, ist notleidend. Zur Bewertung wurde der letzte verfügbare Preis auf dem Markt herangezogen.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Managed Solutions – Asia Focused Income (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung                                   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--------------------------|---------|------------------|------------------------------|--|--------------------------|---------|------------------|------------------------------|
| INDONESIA (GOVT) 7,5 %<br>15.06.35                   | 2.000.000.000            | IDR     | 133.569          | 0,05                         | WYNN MACAU 5,625 %<br>26.08.28                 | 700.000                  | USD     | 664.016          | 0,25                         |
| INDONESIA (GOVT) 8,25 %<br>15.05.29                  | 3.500.000.000            | IDR     | 236.920          | 0,09                         |  |                          |         | <b>1.346.256</b> | <b>0,49</b>                  |
| INDONESIA (GOVT) 8,375 %<br>15.09.26                 | 2.200.000.000            | IDR     | 144.882          | 0,05                         | <b>MALAYSIA</b>                                |                          |         |                  |                              |
| INDONESIA (GOVT) 8,375 %<br>15.03.34                 | 2.500.000.000            | IDR     | 176.983          | 0,06                         | KHAZANAH CAPITAL 4,876 %<br>01/06/2033         | 200.000                  | USD     | 197.671          | 0,07                         |
| INDONESIA (GOVT) 8,375 %<br>15.04.39                 | 2.000.000.000            | IDR     | 143.434          | 0,05                         | MALAYSIA (GOVT) 2,632 %<br>15.04.31            | 1.000.000                | MYR     | 196.773          | 0,07                         |
| PAKUWON JATI 4,875 %<br>29.04.28                     | 224.000                  | USD     | 209.973          | 0,08                         | MALAYSIA (GOVT) 3,502 %<br>31.05.27            | 750.000                  | MYR     | 158.614          | 0,06                         |
| PERTAMINA GEOTHERMAL<br>ENERGY 5,15 % 27.04.28       | 210.000                  | USD     | 209.486          | 0,08                         | MALAYSIA (GOVT) 3,733 %<br>15.06.28            | 1.700.000                | MYR     | 361.411          | 0,13                         |
| STAR ENERGY GEOTHERMAL<br>DARAJAT 4,85 % 14.10.2038  | 200.000                  | USD     | 185.573          | 0,07                         | MALAYSIA (GOVT) 3,882 %<br>14.03.25            | 500.000                  | MYR     | 106.197          | 0,04                         |
| STAR ENGY GEOTHERMAL WAYANG<br>WINDU 6,75 % 24.04.33 | 700.000                  | USD     | 571.947          | 0,22                         | MALAYSIA (GOVT) 3,899 %<br>16.11.27            | 1.300.000                | MYR     | 278.376          | 0,10                         |
|  |                          |         | <b>6.878.539</b> | <b>2,48</b>                  | MALAYSIA (GOVT) 3,906 %<br>15.07.26            | 1.500.000                | MYR     | 320.556          | 0,12                         |
| <b>IRLAND</b>  |                          |         |                  |                              | MALAYSIA (GOVT) 4,065 %<br>15.06.50            | 800.000                  | MYR     | 166.225          | 0,06                         |
| AVOLON HOLDINGS FUNDING<br>5,75 % 01.03.29           | 450.000                  | USD     | 448.878          | 0,16                         | MALAYSIA (GOVT) 4,642 %<br>07/11/2033          | 800.000                  | MYR     | 179.892          | 0,06                         |
| CCBL CAYMAN 1,99 %<br>21.07.25                       | 1.000.000                | USD     | 955.856          | 0,35                         | MALAYSIA (GOVT) 4,709 %<br>15.09.26            | 500.000                  | MYR     | 108.858          | 0,04                         |
|  |                          |         | <b>1.404.734</b> | <b>0,51</b>                  | MALAYSIA (GOVT) 4,762 %<br>07/04/2037          | 500.000                  | MYR     | 114.347          | 0,04                         |
| <b>JAPAN</b>   |                          |         |                  |                              | MALAYSIA (GOVT) 4,893 %<br>08/06/2038          | 900.000                  | MYR     | 209.406          | 0,08                         |
| FUKOKU MUTUAL LIFE<br>INSURANCE 6,8 % VRN PERP       | 341.000                  | USD     | 359.681          | 0,13                         | MALAYSIA (GOVT) 4,921 %<br>06/07/2048          | 600.000                  | MYR     | 141.530          | 0,05                         |
| MITSUBISHI UFJ<br>FINANCIAL 8,2 % VRN PERP           | 200.000                  | USD     | 216.142          | 0,08                         |  |                          |         | <b>2.539.856</b> | <b>0,92</b>                  |
| MIZUHO FINANCIAL 5,579 %<br>26.05.35                 | 200.000                  | USD     | 202.757          | 0,07                         | <b>MAURITIUS</b>                               |                          |         |                  |                              |
| RAKUTEN GROUP 5,125 %<br>VRN PERP                    | 200.000                  | USD     | 172.904          | 0,06                         | CLEAN RENEWABLE POWER<br>4,25 % 25.03.27       | 250.000                  | USD     | 202.742          | 0,07                         |
| RAKUTEN GROUP 11,25 %<br>15.02.27                    | 200.000                  | USD     | 212.034          | 0,08                         | DIAMOND 7,95 % 28.07.2026                      | 200.000                  | USD     | 203.601          | 0,07                         |
| SUMITOMO LIFE INSURANCE<br>5,875 % VRN PERP          | 433.000                  | USD     | 431.885          | 0,15                         | GREENKO SOLAR MAURITIUS<br>5,95 % 29.07.26     | 600.000                  | USD     | 585.591          | 0,21                         |
| SUMITOMO MITSUI TRUST<br>5,35 % 07.03.34             | 321.000                  | USD     | 328.265          | 0,12                         | INDIA AIRPORT INFRA<br>6,25 % 25.10.25         | 250.000                  | USD     | 250.278          | 0,09                         |
|  |                          |         | <b>1.923.668</b> | <b>0,69</b>                  | INDIA GREEN POWER<br>HOLDINGS 4 % 22.02.27     | 250.000                  | USD     | 217.174          | 0,08                         |
| <b>MACAU</b>   |                          |         |                  |                              | NETWORK 3,975 % VRN PERP                       | 250.000                  | USD     | 237.817          | 0,09                         |
| MGM CHINA HOLDINGS<br>4,75 % 01.02.27                | 300.000                  | USD     | 286.216          | 0,10                         |  |                          |         | <b>1.697.203</b> | <b>0,61</b>                  |
| MGM CHINA HOLDINGS<br>5,875 % 15.05.26               | 400.000                  | USD     | 396.024          | 0,14                         | <b>MONGOLEI</b>                                |                          |         |                  |                              |
|  |                          |         |                  |                              | MONGOLIAN MINING CORPENERGY<br>12,5 % 13.09.26 | 290.000                  | USD     | 313.120          | 0,11                         |
|  |                          |         |                  |                              |  |                          |         | <b>313.120</b>   | <b>0,11</b>                  |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Managed Solutions – Asia Focused Income (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung                        | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung                    | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|-------------------------------------|--------------------------|---------|------------------|------------------------------|---------------------------------|--------------------------|---------|------------------|------------------------------|
| <b>NIEDERLANDE</b>                  |                          |         |                  |                              | <b>RIZAL COMMERCIAL</b>         |                          |         |                  |                              |
| MINEJESA CAPITAL 4,625 %            |                          |         |                  |                              | BANKING 6,5 % VRN PERP          | 200.000                  | USD     | 196.924          | 0,07                         |
| 10/08/2030                          | 400.000                  | USD     | 353.261          | 0,13                         | SAN MIGUEL 5,5 % VRN PERP       | 400.000                  | USD     | 390.825          | 0,14                         |
| MINEJESA CAPITAL 5,625 %            |                          |         |                  |                              | SMC GLOBAL POWER                |                          |         |                  |                              |
| 10/08/2037                          | 710.000                  | USD     | 644.132          | 0,23                         | HOLDINGS 5,95 % VRN PERP        | 400.000                  | USD     | 390.295          | 0,14                         |
| MONG DUONG FINANCE HOLDINGS         |                          |         |                  |                              | SMC GLOBAL POWER                |                          |         |                  |                              |
| 5,125 % 07.05.29                    | 250.000                  | USD     | 220.719          | 0,08                         | HOLDINGS 7 % VRN PERP           | 200.000                  | USD     | 195.184          | 0,07                         |
|                                     |                          |         | <b>1.218.112</b> | <b>0,44</b>                  |                                 |                          |         | <b>4.426.654</b> | <b>1,60</b>                  |
| <b>PHILIPPINEN</b>                  |                          |         |                  |                              | <b>SINGAPUR</b>                 |                          |         |                  |                              |
| DEVELOPMENT BANK OF THE PHILLIPINES |                          |         |                  |                              | ABJA INVESTMENT 5,45 %          |                          |         |                  |                              |
| 2,375 % 11.03.31                    | 300.000                  | USD     | 250.239          | 0,09                         | 24.01.28                        | 200.000                  | USD     | 199.777          | 0,07                         |
| METROPOLITAN BANK                   |                          |         |                  |                              | ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT |                          |         |                  |                              |
| 5,375 % 06.03.29                    | 200.000                  | USD     | 200.489          | 0,07                         | 3,468 % 19.04.29                | 500.000                  | SGD     | 367.279          | 0,13                         |
| METROPOLITAN BANK 5,5 %             |                          |         |                  |                              | BOC AVIATION 1,75 %             |                          |         |                  |                              |
| 06/03/2034                          | 200.000                  | USD     | 200.517          | 0,07                         | 21.01.26                        | 900.000                  | USD     | 843.904          | 0,30                         |
| METROPOLITAN BANK TRUST             |                          |         |                  |                              | CHANGI AIRPORT GROUP            |                          |         |                  |                              |
| 2,125 % 15.01.26                    | 700.000                  | USD     | 661.331          | 0,25                         | SINGAPORE 1,88 % 12.05.2031     | 1.500.000                | SGD     | 986.975          | 0,36                         |
| PETRON 5,95 % VRN PERP              | 200.000                  | USD     | 193.240          | 0,07                         | CONTINUUM ENERGY AURA           |                          |         |                  |                              |
| PHILIPPINE (GOVT)                   |                          |         |                  |                              | 9,5 % 24.02.27                  | 400.000                  | USD     | 416.159          | 0,15                         |
| 2,625 % 12.08.25                    | 5.000.000                | PHP     | 85.080           | 0,03                         | DBS GROUP HOLDINGS 3,3 %        |                          |         |                  |                              |
| PHILIPPINE (GOVT)                   |                          |         |                  |                              | VRN PERP                        | 1.500.000                | USD     | 1.463.614        | 0,54                         |
| 2,875 % 09.07.30                    | 11.000.000               | PHP     | 162.468          | 0,06                         | GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES      |                          |         |                  |                              |
| PHILIPPINES (GOVT)                  |                          |         |                  |                              | 3,875 % 04.06.25                | 800.000                  | USD     | 707.062          | 0,25                         |
| 3,625 % 21.03.33                    | 11.000.000               | PHP     | 161.337          | 0,06                         | HOUSING DEVELOPMENT             |                          |         |                  |                              |
| PHILIPPINES (GOVT)                  |                          |         |                  |                              | BOARD 1,971 % 25.01.29          | 500.000                  | SGD     | 348.594          | 0,13                         |
| 4,625 % 02.06.27                    | 10.000.000               | PHP     | 170.518          | 0,06                         | INDIKA ENERGY CAPITAL           |                          |         |                  |                              |
| PHILIPPINE (GOVT)                   |                          |         |                  |                              | 8,25 % 22.10.25                 | 398.000                  | USD     | 401.344          | 0,14                         |
| 4,625 % 09.09.40                    | 3.000.000                | PHP     | 44.735           | 0,02                         | JOLLIBEE WORLDWIDE 3,9 %        |                          |         |                  |                              |
| PHILIPPINE (GOVT) 4,75 %            |                          |         |                  |                              | VRN PERP                        | 200.000                  | USD     | 195.849          | 0,07                         |
| 04/05/2027                          | 10.000.000               | PHP     | 171.410          | 0,06                         | LLPL CAPITAL 6,875 %            |                          |         |                  |                              |
| PHILIPPINE (GOVT)                   |                          |         |                  |                              | 04/02/2039                      | 745.000                  | USD     | 574.713          | 0,21                         |
| 4,875 % 20.01.32                    | 5.000.000                | PHP     | 81.586           | 0,03                         | MEDCO MAPLE TREE 8,96 %         |                          |         |                  |                              |
| PHILIPPINE (GOVT) 5,25 %            |                          |         |                  |                              | 27.04.29                        | 500.000                  | USD     | 520.963          | 0,19                         |
| 18.05.37                            | 3.500.000                | PHP     | 57.032           | 0,02                         | MEDCO OAK TREE 7,375 %          |                          |         |                  |                              |
| PHILIPPINE (GOVT) 5,75 %            |                          |         |                  |                              | 14.05.26                        | 370.000                  | USD     | 370.821          | 0,13                         |
| 12/04/2025                          | 4.000.000                | PHP     | 70.999           | 0,03                         | ONGC VIDESH VANKORNEFT          |                          |         |                  |                              |
| PHILIPPINES (GOVT)                  |                          |         |                  |                              | 3,75 % 27.07.26                 | 1.000.000                | USD     | 963.466          | 0,35                         |
| 6,125 % 24.10.37                    | 4.500.000                | PHP     | 79.624           | 0,03                         | OVERSEACHINESE BANKING          |                          |         |                  |                              |
| PHILIPPINE (GOVT) 6,25 %            |                          |         |                  |                              | 1,832 % VRN 10.09.30            | 700.000                  | USD     | 662.292          | 0,24                         |
| 25.01.34                            | 10.000.000               | PHP     | 178.551          | 0,06                         | OVERSEAS CHINESE BANKING        |                          |         |                  |                              |
| PHILIPPINE (GOVT) 6,25 %            |                          |         |                  |                              | 4,602 % VRN 15.06.32            | 607.000                  | USD     | 594.661          | 0,21                         |
| 20.04.36                            | 5.000.000                | PHP     | 89.308           | 0,03                         | PSA TREASURY 2,88 %             |                          |         |                  |                              |
| PHILIPPINE (GOVT) 6,75 %            |                          |         |                  |                              | 27.04.27                        | 1.250.000                | SGD     | 897.956          | 0,32                         |
| 15.09.32                            | 5.000.000                | PHP     | 92.188           | 0,03                         | SINGAPORE (GOVT) 0,5 %          |                          |         |                  |                              |
| PHILIPPINES (GOVT)                  |                          |         |                  |                              | 01/11/2025                      | 750.000                  | SGD     | 530.581          | 0,19                         |
| 7,25 % 23.06.32                     | 7.000.000                | PHP     | 132.639          | 0,05                         | SINGAPORE (GOVT) 1,25 %         |                          |         |                  |                              |
| PHILIPPINES (GOVT)                  |                          |         |                  |                              | 01/11/2026                      | 250.000                  | SGD     | 176.167          | 0,06                         |
| 8,125 % 16.12.35                    | 4.100.000                | PHP     | 84.298           | 0,03                         | SINGAPORE (GOVT) 1,625 %        |                          |         |                  |                              |
| PHILIPPINES (GOVT)                  |                          |         |                  |                              | 01/07/2031                      | 50.000                   | SGD     | 33.546           | 0,01                         |
| 8,125 % 24.11.42                    | 4.000.000                | PHP     | 85.837           | 0,03                         |                                 |                          |         |                  |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Managed Solutions – Asia Focused Income (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung                                | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung                       | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|------------------------------------|--------------------------|---------|----------|------------------------------|
| SINGAPORE (GOVT) 1,875 %<br>01/03/2050      | 900.000                  | SGD     | 533.762           | 0,19                         | KOREA (GOVT) 1,25 %<br>10/03/2026  | 500.000.000              | KRW     | 356.957  | 0,13                         |
| SINGAPORE (GOVT) 1,875 %<br>01/10/2051      | 170.000                  | SGD     | 99.924            | 0,04                         | KOREA (GOVT) 1,375 %<br>10/12/2029 | 200.000.000              | KRW     | 133.210  | 0,05                         |
| SINGAPORE (GOVT) 2,125 %<br>01/06/2026      | 450.000                  | SGD     | 324.954           | 0,12                         | KOREA (GOVT) 1,375 %<br>10/06/2030 | 150.000.000              | KRW     | 98.926   | 0,04                         |
| SINGAPORE (GOVT) 2,25 %<br>01/07/2036       | 500.000                  | SGD     | 338.786           | 0,12                         | KOREA (GOVT) 1,5 %<br>10/03/2025   | 300.000.000              | KRW     | 219.026  | 0,08                         |
| SINGAPORE (GOVT) 2,375 %<br>01/06/2025      | 200.000                  | SGD     | 146.165           | 0,05                         | KOREA (GOVT) 1,5 %<br>10/12/2026   | 300.000.000              | KRW     | 212.348  | 0,08                         |
| SINGAPORE (GOVT) 2,375 %<br>01/07/2039      | 470.000                  | SGD     | 319.144           | 0,12                         | KOREA (GOVT) 1,5 %<br>10/12/2030   | 320.000.000              | KRW     | 210.744  | 0,08                         |
| SINGAPORE (GOVT) 2,625 %<br>01/05/2028      | 200.000                  | SGD     | 145.627           | 0,05                         | KOREA (GOVT) 1,5 %<br>10/09/2036   | 100.000.000              | KRW     | 60.181   | 0,02                         |
| SINGAPORE (GOVT) 2,75 %<br>01/04/2042       | 270.000                  | SGD     | 192.484           | 0,07                         | KOREA (GOVT) 1,5 %<br>10/09/2040   | 140.000.000              | KRW     | 79.927   | 0,03                         |
| SINGAPORE (GOVT) 2,75 %<br>01/03/2046       | 700.000                  | SGD     | 495.150           | 0,18                         | KOREA (GOVT) 1,5 %<br>10/03/2050   | 400.000.000              | KRW     | 212.136  | 0,08                         |
| SINGAPORE (GOVT) 2,875 %<br>01/09/2030      | 350.000                  | SGD     | 256.234           | 0,09                         | KOREA (GOVT) 1,875 %<br>10/06/2029 | 200.000.000              | KRW     | 137.976  | 0,05                         |
| SINGAPORE (GOVT) 3 %<br>01/08/2072          | 180.000                  | SGD     | 133.454           | 0,05                         | KOREA (GOVT) 1,875 %<br>10/09/2041 | 60.000.000               | KRW     | 35.934   | 0,01                         |
| SINGAPORE (GOVT) 3,375 %<br>01/09/2033      | 50.000                   | SGD     | 37.880            | 0,01                         | KOREA (GOVT) 1,875 %<br>10/03/2051 | 420.000.000              | KRW     | 235.952  | 0,09                         |
| TEMASEK FINANCIAL 1,8 %<br>24.11.26         | 250.000                  | SGD     | 177.188           | 0,06                         | KOREA (GOVT) 2 %<br>10/06/2031     | 300.000.000              | KRW     | 203.031  | 0,07                         |
| TML HOLDINGS 4,35 %<br>09/06/2026           | 200.000                  | USD     | 192.406           | 0,07                         | KOREA (GOVT) 2 %<br>10/03/2046     | 220.000.000              | KRW     | 129.484  | 0,05                         |
| UNITED OVERSEAS BANK<br>1,75 % VRN 16.03.31 | 1.000.000                | USD     | 929.476           | 0,34                         | KOREA (GOVT) 2 %<br>10/03/2049     | 420.000.000              | KRW     | 243.671  | 0,09                         |
|   |                          |         | <b>15.578.357</b> | <b>5,61</b>                  | KOREA (GOVT) 2,125 %<br>10/06/2027 | 500.000.000              | KRW     | 357.941  | 0,13                         |
| <b>SÜDKOREA</b>                             |                          |         |                   |                              | KOREA (GOVT) 2,125 %<br>10/03/2047 | 400.000.000              | KRW     | 239.890  | 0,09                         |
| GS CALTEX 5,375 %<br>07/08/2028             | 414.000                  | USD     | 415.680           | 0,15                         | KOREA (GOVT) 2,25 %<br>10/06/2025  | 400.000.000              | KRW     | 293.216  | 0,11                         |
| HANA BANK 4,375 %<br>30.09.24               | 1.200.000                | USD     | 1.191.164         | 0,42                         | KOREA (GOVT) 2,25 %<br>10/12/2025  | 600.000.000              | KRW     | 437.555  | 0,16                         |
| KB KOOKMIN CARD 4 %<br>09/06/2025           | 646.000                  | USD     | 633.479           | 0,23                         | KOREA (GOVT) 2,25 %<br>10/09/2037  | 110.000.000              | KRW     | 71.697   | 0,03                         |
| KODIT GLOBAL 3,619 %<br>27.05.25            | 300.000                  | USD     | 293.927           | 0,11                         | KOREA (GOVT) 2,375 %<br>10/03/2027 | 600.000.000              | KRW     | 433.956  | 0,16                         |
| KODIT GLOBAL 4,954 %<br>25.05.26            | 200.000                  | USD     | 198.300           | 0,07                         | KOREA (GOVT) 2,375 %<br>10/12/2028 | 100.000.000              | KRW     | 71.095   | 0,03                         |
| KOOKMIN BANK 4,35 % VRN<br>PERP             | 1.100.000                | USD     | 1.093.317         | 0,39                         | KOREA (GOVT) 2,375 %<br>10/12/2031 | 100.000.000              | KRW     | 69.177   | 0,02                         |
| KOREA (GOVT) 1,125 %<br>10/09/2025          | 250.000.000              | KRW     | 179.909           | 0,06                         | KOREA (GOVT) 2,375 %<br>10/09/2038 | 120.000.000              | KRW     | 78.735   | 0,03                         |
| KOREA (GOVT) 1,125 %<br>10/09/2039          | 150.000.000              | KRW     | 81.588            | 0,03                         |                                    |                          |         |          |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Managed Solutions – Asia Focused Income (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung                            | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung                         | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|--------------------------------------|--------------------------|---------|----------|------------------------------|
| KOREA (GOVT) 2,625 %<br>10/09/2035      | 50.000.000               | KRW     | 34.506            | 0,01                         | <b>THAILAND</b>                      |                          |         |          |                              |
| KOREA (GOVT) 2,625 %<br>10/03/2048      | 300.000.000              | KRW     | 197.647           | 0,07                         | BANGKOK BANK 3,466 % VRN<br>23.09.36 | 700.000                  | USD     | 591.430  | 0,21                         |
| KOREA (GOVT) 3,25 %<br>10/09/2042       | 200.000.000              | KRW     | 146.261           | 0,05                         | BANGKOK BANK 3,733 % VRN<br>25.09.34 | 400.000                  | USD     | 356.908  | 0,13                         |
| KOREA (GOVT) 3,25 %<br>10/03/2053       | 500.000.000              | KRW     | 369.071           | 0,13                         | BANGKOK BANK 5 % VRN<br>PERP         | 400.000                  | USD     | 389.687  | 0,14                         |
| KOREA (GOVT) 3,375 %<br>10/06/2032      | 250.000.000              | KRW     | 185.225           | 0,07                         | BANGKOK BANK 5,5 %<br>21.09.33       | 400.000                  | USD     | 403.699  | 0,15                         |
| KOREA (GOVT) 3,5 %<br>10/09/2028        | 220.000.000              | KRW     | 164.618           | 0,06                         | GC TREASURY CENTER 4,4 %<br>30.03.32 | 400.000                  | USD     | 364.452  | 0,13                         |
| KOREA (GOVT) 3,625 %<br>10/09/2025      | 100.000.000              | KRW     | 74.581            | 0,03                         | KASIKORNBANK 5,275 % VRN<br>PERP     | 500.000                  | USD     | 488.110  | 0,18                         |
| KOREA (GOVT) 3,875 %<br>10/09/2043      | 120.000.000              | KRW     | 95.681            | 0,03                         | KRUNG THAI BANK 4,4 %<br>VRN PERP    | 210.000                  | USD     | 199.691  | 0,07                         |
| KOREA (GOVT) 4,125 %<br>10/12/2033      | 160.000.000              | KRW     | 126.301           | 0,05                         | THAILAND (GOVT) 0,95 %<br>17.06.25   | 4.000.000                | THB     | 108.068  | 0,04                         |
| KOREA (GOVT) 4,25 %<br>10/12/2032       | 200.000.000              | KRW     | 157.888           | 0,06                         | THAILAND (GOVT) 1,585 %<br>17.12.35  | 5.000.000                | THB     | 123.229  | 0,04                         |
| NONGHYUP BANK 4,875 %<br>03/07/2028     | 616.000                  | USD     | 613.563           | 0,22                         | THAILAND (GOVT) 1,6 %<br>17.12.29    | 6.000.000                | THB     | 158.733  | 0,06                         |
| POSCO 4,875 % 23.01.27                  | 200.000                  | USD     | 197.612           | 0,07                         | THAILAND (GOVT) 1,6 %<br>17.06.35    | 4.000.000                | THB     | 99.405   | 0,04                         |
| POSCO 5,75 % 17.01.28                   | 200.000                  | USD     | 203.170           | 0,07                         | THAILAND (GOVT) 1,875 %<br>17.06.49  | 5.000.000                | THB     | 106.877  | 0,04                         |
| SHINHAN BANK 3,875 %<br>24.03.26        | 1.500.000                | USD     | 1.450.590         | 0,51                         | THAILAND (GOVT) 2 %<br>17.12.31      | 5.000.000                | THB     | 133.415  | 0,05                         |
| SHINHAN CARD 2,5 %<br>27.01.27          | 700.000                  | USD     | 646.595           | 0,23                         | THAILAND (GOVT) 2 %<br>17.06.42      | 4.000.000                | THB     | 96.331   | 0,03                         |
| SHINHAN CARD 5,5 %<br>12/03/2029        | 200.000                  | USD     | 201.411           | 0,07                         | THAILAND (GOVT) 2,125 %<br>17.12.26  | 6.000.000                | THB     | 164.335  | 0,06                         |
| SK BROADBAND 4,875 %<br>28.06.28        | 200.000                  | USD     | 198.193           | 0,07                         | THAILAND (GOVT) 2,75 %<br>17.06.52   | 5.800.000                | THB     | 145.858  | 0,05                         |
| SK HYNIX 5,5 % 16.01.2027               | 368.000                  | USD     | 368.247           | 0,13                         | THAILAND (GOVT) 2,875 %<br>17.12.28  | 2.500.000                | THB     | 70.531   | 0,03                         |
| SK HYNIX 5,5 % 16.01.29                 | 466.000                  | USD     | 465.438           | 0,17                         | THAILAND (GOVT) 2,875 %<br>17.06.46  | 5.000.000                | THB     | 133.397  | 0,05                         |
| SK ON 5,375 % 11.05.2026                | 200.000                  | USD     | 200.412           | 0,07                         | THAILAND (GOVT) 3,3 %<br>17.06.38    | 3.000.000                | THB     | 87.582   | 0,03                         |
|   |                          |         | <b>14.807.139</b> | <b>5,34</b>                  | THAILAND (GOVT) 3,4 %<br>17.06.36    | 4.000.000                | THB     | 118.294  | 0,04                         |
| <b>SRI LANKA</b>                        |                          |         |                   |                              | THAILAND (GOVT) 3,45 %<br>17.06.43   | 3.000.000                | THB     | 87.596   | 0,03                         |
| SRI LANKA (GOVT) 6,35 %<br>28.06.24     | 270.000                  | USD     | 159.959           | 0,06                         | THAILAND (GOVT) 3,6 %<br>17.06.67    | 10.600.000               | THB     | 294.675  | 0,11                         |
| SRI LANKA (GOVT) 6,85 %<br>14.03.2024** | 500.000                  | USD     | 276.250           | 0,10                         | THAILAND (GOVT) 3,65 %<br>20.06.31   | 4.000.000                | THB     | 118.989  | 0,04                         |
|   |                          |         | <b>436.209</b>    | <b>0,16</b>                  | THAILAND (GOVT) 3,775 %<br>25.06.32  | 6.000.000                | THB     | 180.792  | 0,07                         |
| <b>TAIWAN</b>                           |                          |         |                   |                              |                                      |                          |         |          |                              |
| TSMC GLOBAL 1,375 %<br>28.09.30         | 600.000                  | USD     | 486.622           | 0,18                         |                                      |                          |         |          |                              |
| TSMC GLOBAL 2,25 %<br>23.04.31          | 650.000                  | USD     | 552.282           | 0,19                         |                                      |                          |         |          |                              |
|   |                          |         | <b>1.038.904</b>  | <b>0,37</b>                  |                                      |                          |         |          |                              |

\*\* Der Vermögenswert, der am 14. März 2024 fällig war, ist notleidend. Zur Bewertung wurde der letzte verfügbare Preis auf dem Markt herangezogen.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Managed Solutions – Asia Focused Income (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|--------------------|------------------------------|--|--------------------------|---------|------------------|------------------------------|
| THAILAND (GOVT) 3,85 %<br>12/12/2025                                | 5.500.000                | THB     | 155.043            | 0,06                         | <b>AN EINEM ANDEREM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE, ÜBERTRAGBARE<br/>WERTPAPIERE</b> |                          |         |                  |                              |
| THAIOIL TREASURY CENTER<br>4,875 % 23.01.43                         | 803.000                  | USD     | 704.122            | 0,24                         | <b>ANLEIHEN</b>  |                          |         |                  |                              |
|   |                          |         | <b>5.881.249</b>   | <b>2,12</b>                  | <b>AUSTRALIEN</b>  |                          |         |                  |                              |
| <b>USA</b>  |                          |         |                    |                              | <b>AUSTRALIA NEW ZEALAND BANKING</b>   |                          |         |                  |                              |
| HANWHA ENERGY USA<br>HOLDINGS 4,125 % 05.07.25                      | 433.000                  | USD     | 425.617            | 0,15                         | 2,95 % VRN 22.07.30  | 500.000                  | USD     | 480.560          | 0,17                         |
| HANWHA Q CELLS AMERICAS<br>HOLDINGS 5 % 27.07.28                    | 247.000                  | USD     | 247.015            | 0,09                         | CIMIC FINANCE 7 %<br>25.03.34  | 359.000                  | USD     | 368.731          | 0,13                         |
| HYUNDAI CAPITAL AMERICA<br>5,3 % 08.01.29                           | 277.000                  | USD     | 277.534            | 0,10                         | COMMONWEALTH BANK OF<br>AUSTRALIA 5,837 %<br>13.03.34                            | 400.000                  | USD     | 402.576          | 0,15                         |
| HYUNDAI CAPITAL AMERICA<br>5,8 % 26.06.25                           | 208.000                  | USD     | 208.530            | 0,08                         |  |                          |         | <b>1.251.867</b> | <b>0,45</b>                  |
| PERIAMA HOLDINGS 5,95 %<br>19.04.26                                 | 201.000                  | USD     | 198.779            | 0,07                         | <b>CHINA</b>   |                          |         |                  |                              |
| RESORTS WORLD LAS VEGAS<br>4,625 % 06.04.31                         | 200.000                  | USD     | 174.456            | 0,06                         | ALIBABA GROUP 3,15 %<br>09/02/2051   | 1.000.000                | USD     | 668.250          | 0,24                         |
| RESORTS WORLD LAS VEGAS<br>8,45 % 27.07.30                          | 400.000                  | USD     | 431.860            | 0,16                         | CHINA CINDA FINANCE<br>4,25 % 23.04.25   | 700.000                  | USD     | 689.442          | 0,25                         |
| SASOL FINANCING 8,75 %<br>03/05/2029                                | 200.000                  | USD     | 203.717            | 0,07                         | ENN ENERGY HOLDINGS<br>4,625 % 17.05.27  | 263.000                  | USD     | 258.063          | 0,09                         |
| TSMC ARIZONA 2,5 %<br>25.10.31                                      | 650.000                  | USD     | 555.798            | 0,20                         | JDCOM 3,875 % 29.04.26   | 600.000                  | USD     | 583.010          | 0,21                         |
|   |                          |         | <b>2.723.306</b>   | <b>0,98</b>                  | MEITUAN DIANPING 3,05 %<br>28.10.30  | 1.000.000                | USD     | 858.294          | 0,31                         |
| <b>SUMME ANLEIHEN</b>   |                          |         | <b>125.479.850</b> | <b>45,24</b>                 | SANDS CHINA 3,8 %<br>08/01/2026  | 1.000.000                | USD     | 962.090          | 0,35                         |
| <b>DEPOSITARY RECEIPTS</b>  |                          |         |                    |                              | SANDS CHINA 4,375 %<br>18.06.30  | 800.000                  | USD     | 733.930          | 0,26                         |
| <b>INDIEN</b>   |                          |         |                    |                              | TENCENT HOLDINGS 3,24 %<br>03/06/2050  | 500.000                  | USD     | 340.073          | 0,12                         |
| HDFC BANK   | 40.366                   | USD     | 2.252.423          | 0,81                         | TENCENT HOLDINGS 3,595 %<br>19.01.28   | 1.500.000                | USD     | 1.425.797        | 0,51                         |
| INFOSYS   | 43.366                   | USD     | 779.504            | 0,28                         | TENCENT HOLDINGS 3,975 %<br>11/04/2029   | 2.200.000                | USD     | 2.092.496        | 0,76                         |
|   |                          |         | <b>3.031.927</b>   | <b>1,09</b>                  |  |                          |         | <b>8.611.445</b> | <b>3,10</b>                  |
| <b>SUMME DEPOSITARY RECEIPTS</b>                                    |                          |         | <b>3.031.927</b>   | <b>1,09</b>                  | <b>GROSSBRITANNIEN</b>   |                          |         |                  |                              |
| <b>VORZUGSAKTIEN</b>  |                          |         |                    |                              | STANDARD CHARTERED 4,3 %<br>VRN PERP   | 500.000                  | USD     | 412.388          | 0,15                         |
| <b>SÜDKOREA</b>   |                          |         |                    |                              | STANDARD CHARTERED 6 %<br>VRN PERP   | 250.000                  | USD     | 246.990          | 0,09                         |
| SAMSUNG ELECTRONICS   | 93.246                   | KRW     | 4.654.508          | 1,68                         | STANDARD CHARTERED<br>7,875 % VRN PERP   | 629.000                  | USD     | 628.125          | 0,22                         |
|   |                          |         | <b>4.654.508</b>   | <b>1,68</b>                  |  |                          |         | <b>1.287.503</b> | <b>0,46</b>                  |
| <b>SUMME VORZUGSAKTIEN</b>  |                          |         | <b>4.654.508</b>   | <b>1,68</b>                  |  |                          |         |                  |                              |
| <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN<br/>BÖRSE NOTIERTEN WERTPAPIERE</b> |                          |         | <b>215.541.255</b> | <b>77,69</b>                 |  |                          |         |                  |                              |
| <b>WERTPAPIERE</b>  |                          |         |                    |                              |  |                          |         |                  |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Managed Solutions – Asia Focused Income (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung               | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung               | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|----------------------------|--------------------------|---------|------------------|------------------------------|----------------------------|--------------------------|---------|------------------|------------------------------|
| <b>HONGKONG</b>            |                          |         |                  |                              | <b>MALAYSIA</b>            |                          |         |                  |                              |
| AIA GROUP 4,95 %           |                          |         |                  |                              | GOHL CAPITAL 4,25 %        |                          |         |                  |                              |
| 04/04/2033                 | 200.000                  | USD     | 200.094          | 0,07                         | 24.01.27                   | 400.000                  | USD     | 384.932          | 0,14                         |
| AIA GROUP 5,375 %          |                          |         |                  |                              | MALAYSIA (GOVT) 3,757 %    |                          |         |                  |                              |
| 05/04/2034                 | 200.000                  | USD     | 200.260          | 0,07                         | 22.05.40                   | 2.600.000                | MYR     | 534.039          | 0,19                         |
| CK HUTCHISON               |                          |         |                  |                              | MALAYSIA (GOVT) 4,127 %    |                          |         |                  |                              |
| INTERNATIONAL 2,5 %        |                          |         |                  |                              | 15.04.32                   | 300.000                  | MYR     | 64.688           | 0,02                         |
| 08/05/2030                 | 1.100.000                | USD     | 959.860          | 0,35                         | MALAYSIA (GOVT) 4,457 %    |                          |         |                  |                              |
| STUDIO CITY 7 % 15.02.2027 | 400.000                  | USD     | 400.799          | 0,14                         | 31.03.53                   | 900.000                  | MYR     | 199.172          | 0,07                         |
|                            |                          |         | <b>1.761.013</b> | <b>0,63</b>                  | MALAYSIA (GOVT) 4,498 %    |                          |         |                  |                              |
|                            |                          |         |                  |                              | 15.04.30                   | 1.500.000                | MYR     | 330.004          | 0,12                         |
| <b>INDIEN</b>              |                          |         |                  |                              | MALAYSIA (GOVT) 4,504 %    |                          |         |                  |                              |
| ADANI GREEN ENERGY 6,7 %   |                          |         |                  |                              | 30.04.29                   | 1.200.000                | MYR     | 263.943          | 0,10                         |
| 12/03/2042                 | 200.000                  | USD     | 193.891          | 0,07                         |                            |                          |         | <b>1.776.778</b> | <b>0,64</b>                  |
| HDFC BANK 3,7 % VRN PERP   | 630.000                  | USD     | 581.286          | 0,21                         | <b>MAURITIUS</b>           |                          |         |                  |                              |
| HDFC BANK 5,196 %          |                          |         |                  |                              | AZURE POWER ENERGY         |                          |         |                  |                              |
| 15.02.27                   | 200.000                  | USD     | 198.767          | 0,07                         | 3,575 % 19.08.26           | 200.000                  | USD     | 150.083          | 0,05                         |
| IRB INFRASTRUCTURE DEVE-   |                          |         |                  |                              | CA MAGNUM HOLDINGS         |                          |         |                  |                              |
| LOPERS 7,11 % 11.03.32     | 200.000                  | USD     | 203.092          | 0,07                         | 5,375 % 31.10.26           | 450.000                  | USD     | 432.495          | 0,16                         |
| JSW HYDRO ENERGY 4,125 %   |                          |         |                  |                              | GREENKO WIND PROJECTS      |                          |         |                  |                              |
| 18.05.31                   | 265.000                  | USD     | 189.305          | 0,07                         | MAURITIUS 5,5 % 06.04.2025 | 260.000                  | USD     | 256.403          | 0,09                         |
| JSW STEEL 3,95 %           |                          |         |                  |                              | NETWORK 5,65 % VRN PERP    | 295.000                  | USD     | 292.941          | 0,11                         |
| 05/04/2027                 | 200.000                  | USD     | 186.179          | 0,07                         |                            |                          |         | <b>1.131.922</b> | <b>0,41</b>                  |
| JSW STEEL 5,05 %           |                          |         |                  |                              | <b>NIEDERLANDE</b>         |                          |         |                  |                              |
| 05/04/2032                 | 200.000                  | USD     | 176.358          | 0,06                         | LISTRINDO CAPITAL 4,95 %   |                          |         |                  |                              |
| RELIANCE INDUSTRIES        |                          |         |                  |                              | 14.09.26                   | 200.000                  | USD     | 193.703          | 0,07                         |
| 3,625 % 12.01.52           | 600.000                  | USD     | 435.922          | 0,16                         | PROSUS 4,987 % 19.01.52    | 200.000                  | USD     | 147.616          | 0,05                         |
| RELIANCE INDUSTRIES        |                          |         |                  |                              |                            |                          |         | <b>341.319</b>   | <b>0,12</b>                  |
| 3,667 % 30.11.27           | 1.000.000                | USD     | 948.272          | 0,34                         | <b>PHILIPPINEN</b>         |                          |         |                  |                              |
| SHRIRAM FINANCE 6,625 %    |                          |         |                  |                              | PHILIPPINE (GOVT) 6,25 %   |                          |         |                  |                              |
| 22.04.27                   | 236.000                  | USD     | 237.070          | 0,09                         | 22.03.28                   | 10.000.000               | PHP     | 178.652          | 0,07                         |
|                            |                          |         | <b>3.350.142</b> | <b>1,21</b>                  | PHILIPPINE (GOVT) 6,75 %   |                          |         |                  |                              |
|                            |                          |         |                  |                              | 24.01.39                   | 5.000.000                | PHP     | 93.797           | 0,03                         |
| <b>INDONESIEN</b>          |                          |         |                  |                              | PHILIPPINE (GOVT)          |                          |         |                  |                              |
| FREEPORT INDONESIA         |                          |         |                  |                              | 7,625 % 29.09.36           | 1.700.000                | PHP     | 33.946           | 0,01                         |
| 5,315 % 14.04.32           | 500.000                  | USD     | 489.446          | 0,18                         | PHILIPPINES (GOVT) 8 %     |                          |         |                  |                              |
| FREEPORT INDONESIA 6,2 %   |                          |         |                  |                              | 19.07.31                   | 8.000.000                | PHP     | 156.772          | 0,06                         |
| 14.04.52                   | 1.020.000                | USD     | 1.016.236        | 0,37                         |                            |                          |         | <b>463.167</b>   | <b>0,17</b>                  |
|                            |                          |         | <b>1.505.682</b> | <b>0,55</b>                  | <b>SINGAPUR</b>            |                          |         |                  |                              |
|                            |                          |         |                  |                              | CONTINUUM ENERGY           |                          |         |                  |                              |
| <b>IRLAND</b>              |                          |         |                  |                              | LEVANTER 4,5 % 09.02.2027  | 230.000                  | USD     | 189.297          | 0,07                         |
| SMBC AVIATION CAPITAL      |                          |         |                  |                              |                            |                          |         | <b>189.297</b>   | <b>0,07</b>                  |
| FINANCE 5,7 % 25.07.33     | 836.000                  | USD     | 844.424          | 0,30                         |                            |                          |         |                  |                              |
|                            |                          |         | <b>844.424</b>   | <b>0,30</b>                  | <b>SÜDKOREA</b>            |                          |         |                  |                              |
|                            |                          |         |                  |                              | HANWHA LIFE INSURANCE      |                          |         |                  |                              |
| <b>MACAU</b>               |                          |         |                  |                              | 3,379 % VRN 04.02.32       | 600.000                  | USD     | 557.603          | 0,20                         |
| MGM CHINA HOLDINGS         |                          |         |                  |                              | HYUNDAI CAPITAL            |                          |         |                  |                              |
| 5,25 % 18.06.25            | 200.000                  | USD     | 197.289          | 0,07                         | SERVICES 5,125 % 05.02.27  | 240.000                  | USD     | 238.370          | 0,09                         |
| SANDS CHINA 5,4 %          |                          |         |                  |                              | KOREA (GOVT) 1,875 %       |                          |         |                  |                              |
| 08/08/2028                 | 800.000                  | USD     | 785.101          | 0,28                         | 10/06/2026                 | 300.000.000              | KRW     | 216.016          | 0,08                         |
| WYNN MACAU 5,5 %           |                          |         |                  |                              | KT 4 % 08.08.25            | 552.000                  | USD     | 542.271          | 0,20                         |
| 15.01.26                   | 300.000                  | USD     | 292.409          | 0,11                         | POSCO 4,375 % 04.08.25     | 944.000                  | USD     | 929.499          | 0,34                         |
|                            |                          |         | <b>1.274.799</b> | <b>0,46</b>                  |                            |                          |         | <b>2.483.759</b> | <b>0,91</b>                  |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Managed Solutions – Asia Focused Income (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|---|--------------------------|---------|--------------------|------------------------------|
| <b>TAIWAN</b>   |                          |         |                   |                              | <b>HONGKONG</b>                                       |                          |         |                    |                              |
| TSMC GLOBAL 1,25 %<br>23.04.26  | 700.000                  | USD     | 648.234           | 0,23                         | YANGO JUSTICE INTERNATIONAL<br>9,25 % 15.04.2023***** | 200.000                  | USD     | 1.500              | 0,00                         |
|   |                          |         | <b>648.234</b>    | <b>0,23</b>                  | YANGO JUSTICE INTERNATIONAL<br>10,25 % 15.09.20*****  | 400.000                  | USD     | -                  | 0,00                         |
| <b>VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE</b>   |                          |         |                   |                              |   |                          |         | <b>1.500</b>       | <b>0,00</b>                  |
| FIRST ABU DHABI BANK<br>6,32 % VRN 04.04.34   | 500.000                  | USD     | 511.829           | 0,18                         | <b>INDONESIEN</b>                                     |                          |         |                    |                              |
|   |                          |         | <b>511.829</b>    | <b>0,18</b>                  | KAWASAN INDUSTRI JABABEKA<br>TBK 7 % 15.12.27         | 335.000                  | USD     | 307.396            | 0,11                         |
| <b>USA</b>  |                          |         |                   |                              |   |                          |         | <b>307.396</b>     | <b>0,11</b>                  |
| HYUNDAI CAPITAL AMERICA<br>6,5 % 16.01.29   | 295.000                  | USD     | 310.113           | 0,11                         | <b>MALAYSIA</b>                                       |                          |         |                    |                              |
| SK BATTERY AMERICA<br>4,875 % 23.01.27  | 212.000                  | USD     | 210.187           | 0,08                         | MALAYSIA (GOVT) 3,582 %<br>15.07.32                   | 900.000                  | MYR     | 186.839            | 0,07                         |
| TSMC ARIZONA 3,875 %<br>22.04.27  | 459.000                  | USD     | 445.903           | 0,16                         | MALAYSIA (GOVT) 3,828 %<br>05/07/2034                 | 2.000.000                | MYR     | 422.380            | 0,14                         |
|   |                          |         | <b>966.203</b>    | <b>0,35</b>                  | MALAYSIA (GOVT) 3,844 %<br>15.04.33                   | 200.000                  | MYR     | 42.263             | 0,02                         |
| <b>SUMME ANLEIHEN</b>   |                          |         | <b>28.399.383</b> | <b>10,24</b>                 | MALAYSIA (GOVT) 3,955 %<br>15.09.25                   | 1.000.000                | MYR     | 213.230            | 0,08                         |
| <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN<br/>MARKT GEHANDELTEN ÜBERTRAGBAREN WERTPAPIERE</b> |                          |         | <b>28.399.383</b> | <b>10,24</b>                 | MALAYSIA (GOVT) 4,736 %<br>15.03.46                   | 400.000                  | MYR     | 91.640             | 0,03                         |
| <b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>  |                          |         |                   |                              |   |                          |         | <b>956.352</b>     | <b>0,34</b>                  |
| <b>IRLAND</b>   |                          |         |                   |                              | <b>THAILAND</b>                                       |                          |         |                    |                              |
| HSBC MSCI INDONESIA<br>UCITS ETF  | 30.405                   | USD     | 2.512.669         | 0,91                         | THAILAND (GOVT) 1 %<br>17.06.27                       | 9.000.000                | THB     | 237.731            | 0,09                         |
| HSBC MSCI KOREA ETF   | 38.329                   | USD     | 2.106.945         | 0,76                         | THAILAND (GOVT) 2,25 %<br>17.03.27                    | 2.000.000                | THB     | 54.947             | 0,02                         |
|   |                          |         | <b>4.619.614</b>  | <b>1,67</b>                  | THAILAND (GOVT) 2,35 %<br>17.06.26                    | 6.000.000                | THB     | 165.177            | 0,06                         |
| <b>LUXEMBURG</b>  |                          |         |                   |                              |   |                          |         |                    |                              |
| HGIF GEM LOCAL CURRENCY<br>RATES „ZD“   | 823.962                  | USD     | 6.234.099         | 2,25                         | THAILAND (GOVT) 2,4 %<br>17.03.29                     | 5.000.000                | THB     | 138.058            | 0,05                         |
| HGIF GLOBAL EMERGING<br>MARKETS BOND „ZQ“   | 939.455                  | USD     | 7.009.270         | 2,53                         | THAILAND (GOVT) 2,65 %<br>17.06.28                    | 9.500.000                | THB     | 264.998            | 0,10                         |
| HGIF INDIA FIXED INCOME<br>„ZD“   | 674.799                  | USD     | 6.004.362         | 2,16                         | THAILAND (GOVT) 3,35 %<br>17.06.33                    | 9.000.000                | THB     | 263.447            | 0,09                         |
| HGIF INDIA EQUITY<br>Z INC  | 10.649                   | USD     | 3.588.026         | 1,29                         | THAILAND (GOVT) 3,39 %<br>17.06.37                    | 4.000.000                | THB     | 118.067            | 0,04                         |
|   |                          |         | <b>22.835.757</b> | <b>8,23</b>                  |   |                          |         | <b>1.242.425</b>   | <b>0,45</b>                  |
| <b>SUMME ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>                                      |                          |         | <b>27.455.371</b> | <b>9,90</b>                  | <b>USA</b>  |                          |         |                    |                              |
| <b>SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>  |                          |         |                   |                              |   |                          |         |                    |                              |
| <b>ANLEIHEN</b>   |                          |         |                   |                              |   |                          |         |                    |                              |
| <b>CHINA</b>  |                          |         |                   |                              |   |                          |         |                    |                              |
| REDCO PROPERTIES GROUP<br>9,9 % 17.02.24***   | 200.000                  | USD     | 2.028             | 0,00                         | FLOURISH CENTURY 6,6 %<br>04.02.2022*****             | 400.000                  | USD     | -                  | 0,00                         |
| REDCO PROPERTIES GROUP<br>11 % 06.08.2023****                                       | 410.634                  | USD     | 5.291             | 0,00                         |   |                          |         | -                  | <b>0,00</b>                  |
|   |                          |         | <b>7.319</b>      | <b>0,00</b>                  | <b>SUMME ANLEIHEN</b>                                 |                          |         | <b>2.514.992</b>   | <b>0,90</b>                  |
| <b>SUMME SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>                                      |                          |         |                   |                              |   |                          |         | <b>2.514.992</b>   | <b>0,90</b>                  |
| <b>SUMME WERTPAPIERANLAGEN</b>  |                          |         |                   |                              |   |                          |         | <b>273.911.001</b> | <b>98,73</b>                 |
| <b>SONSTIGES NETTOVERMÖGEN</b>  |                          |         |                   |                              |   |                          |         | <b>3.522.597</b>   | <b>1,27</b>                  |
| <b>GESAMTNETTOVERMÖGEN</b>  |                          |         |                   |                              |   |                          |         | <b>277.433.598</b> | <b>100,00</b>                |

\*\*\* Der Vermögenswert, der am 17. Februar 2024 fällig war, ist notleidend. Der Ausschuss für die Preisbestimmung und die Verwaltungsgesellschaft haben vereinbart und veranlasst, den beizulegenden Zeitwert des Wertpapiers auf 2.028 USD festzusetzen.

\*\*\*\* Der Vermögenswert, der am 6. August 2023 fällig war, ist notleidend. Der Ausschuss für die Preisbestimmung und die Verwaltungsgesellschaft haben vereinbart und veranlasst, den beizulegenden Zeitwert des Wertpapiers auf 5.291 USD festzusetzen.

\*\*\*\*\* Der Vermögenswert, der am 15. April 2023 fällig war, ist notleidend. Der Ausschuss für die Preisbestimmung und die Verwaltungsgesellschaft haben vereinbart und veranlasst, den beizulegenden Zeitwert des Wertpapiers auf 1.500 USD festzusetzen.

\*\*\*\*\* Der Vermögenswert, der am 15. September 2020 fällig war, ist notleidend. Der Ausschuss für die Preisbestimmung und die Verwaltungsgesellschaft haben vereinbart und veranlasst, das Wertpapier auf null abzuschreiben.

\*\*\*\*\* Der Vermögenswert, der am 4. Februar 2022 fällig war, ist notleidend. Der Ausschuss für die Preisbestimmung und die Verwaltungsgesellschaft haben vereinbart und veranlasst, das Wertpapier auf null abzuschreiben.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Multi-Asset Style Factors

Aufstellung der Wertpapiervermögensanlagen zum 31. März 2024

(in EUR)

| Beschreibung                                   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung                  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|-------------------------------|--------------------------|---------|--------------------|------------------------------|
| <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>                       |                          |         |                   |                              | <b>CREDIT AGRICOLE 0 %</b>    |                          |         |                    |                              |
| <b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>       |                          |         |                   |                              | 02/01/2025                    |                          |         |                    |                              |
| <b>FRANKREICH</b>                              |                          |         |                   |                              | ING BANK 0,33 % 04.10.2024    |                          |         |                    |                              |
| HSBC MONEY SRI „ZC“                            | 31.230                   | EUR     | 44.465.986        | 5,41                         | JYBCDC PPGM29KT 0 %           | 35.000.000               | EUR     | 35.025.060         | 4,25                         |
|  |                          |         | <u>44.465.986</u> | <u>5,41</u>                  | 03/04/2024                    | 16.000.000               | EUR     | 15.990.833         | 1,95                         |
| <b>SUMME ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b> |                          |         | <b>44.465.986</b> | <b>5,41</b>                  | MATCHPOINT FINANCE 0 %        | 20.000.000               | EUR     | 19.945.603         | 2,43                         |
|  |                          |         |                   |                              | 22.04.24                      |                          |         |                    |                              |
| <b>GELDMARKTINSTRUMENTE</b>                    |                          |         |                   |                              | MATCHPOINT FINANCE 0 %        |                          |         |                    |                              |
| <b>EINLAGENZERTIFIKATE</b>                     |                          |         |                   |                              | 02/05/2024                    |                          |         |                    |                              |
| <b>BELGIEN</b>                                 |                          |         |                   |                              | NATIXIS 0 % 08.08.2024        |                          |         |                    |                              |
| BELFIUS BANK 0 %                               |                          |         |                   |                              | NATIXIS 0 % 02.01.25          | 11.000.000               | EUR     | 11.000.000         | 1,34                         |
| 02/05/2024                                     | 7.000.000                | EUR     | 6.974.360         | 0,85                         | NATIXIS 0 % 02.01.25          |                          |         |                    |                              |
| SUMITOMO MITSUI 0 %                            |                          |         |                   |                              | (FR0128382084)                | 5.000.000                | EUR     | 5.000.000          | 0,61                         |
| 25.04.24                                       | 16.000.000               | EUR     | 15.951.780        | 1,94                         | RTEEDF PPGJ5HPT 0 %           |                          |         |                    |                              |
|  |                          |         | <u>22.926.140</u> | <u>2,79</u>                  | 22.04.24                      | 5.000.000                | EUR     | 4.987.062          | 0,61                         |
| <b>KANADA</b>                                  |                          |         |                   |                              | SG EUR 0 % 02.04.2024         |                          |         |                    |                              |
| TORONTO 0 % 20.06.2024                         | 15.000.000               | EUR     | 15.008.148        | 1,83                         | TOTCPP PPGJ5UY0 0 %           | 14.000.000               | EUR     | 14.000.000         | 1,70                         |
|  |                          |         | <u>15.008.148</u> | <u>1,83</u>                  | 03/04/2024                    | 12.000.000               | EUR     | 11.992.115         | 1,46                         |
| <b>JAPAN</b>                                   |                          |         |                   |                              | UNEDIC PPGI6GXD 0 %           |                          |         |                    |                              |
| MIZUHO BANK 0 %                                |                          |         |                   |                              | 09/04/2024                    | 24.000.000               | EUR     | 23.981.581         | 2,92                         |
| 02/05/2024                                     | 19.000.000               | EUR     | 18.929.859        | 2,30                         |                               |                          |         | <u>284.381.347</u> | <u>34,58</u>                 |
|  |                          |         | <u>18.929.859</u> | <u>2,30</u>                  | <b>DEUTSCHLAND</b>            |                          |         |                    |                              |
| <b>SÜDKOREA</b>                                |                          |         |                   |                              | LBW PPGH62UR 0 %              |                          |         |                    |                              |
| SHINLO PPGJ5ISX 0 %                            |                          |         |                   |                              | 02/04/2024                    | 3.000.000                | EUR     | 2.998.337          | 0,37                         |
| 22.04.24                                       | 7.000.000                | EUR     | 6.982.023         | 0,85                         | LBW PPGH6ARY 0 %              |                          |         |                    |                              |
|  |                          |         | <u>6.982.023</u>  | <u>0,85</u>                  | 03/04/2024                    | 1.000.000                | EUR     | 999.234            | 0,12                         |
| <b>SUMME EINLAGENZERTIFIKATE</b>               |                          |         | <b>63.846.170</b> | <b>7,77</b>                  |                               |                          |         | <u>3.997.571</u>   | <u>0,49</u>                  |
| <b>COMMERCIAL PAPER</b>                        |                          |         |                   |                              | <b>GROSSBRITANNIEN</b>        |                          |         |                    |                              |
| <b>BELGIEN</b>                                 |                          |         |                   |                              | LAND PPGL3APJ 0 %             |                          |         |                    |                              |
| SUMITOMO MITSUI 0 %                            |                          |         |                   |                              | 12/04/2024                    | 16.500.000               | EUR     | 16.475.726         | 2,00                         |
| 11/04/2024                                     | 25.000.000               | EUR     | 24.961.425        | 3,04                         |                               |                          |         | <u>16.475.726</u>  | <u>2,00</u>                  |
|  |                          |         | <u>24.961.425</u> | <u>3,04</u>                  | <b>IRLAND</b>                 |                          |         |                    |                              |
| <b>FRANKREICH</b>                              |                          |         |                   |                              | MATFIN PPGJ5QZ3 0 %           |                          |         |                    |                              |
| ANTAL PPGM2OIO 0 %                             |                          |         |                   |                              | 03/04/2024                    | 30.000.000               | EUR     | 29.976.976         | 3,65                         |
| 03/04/2024                                     | 5.000.000                | EUR     | 4.996.163         | 0,61                         |                               |                          |         | <u>29.976.976</u>  | <u>3,65</u>                  |
| BFCM 0 % 22.07.24                              | 3.000.000                | EUR     | 3.000.690         | 0,36                         | <b>NIEDERLANDE</b>            |                          |         |                    |                              |
| BFCM 0 % 01.08.24                              | 3.000.000                | EUR     | 3.000.000         | 0,36                         | ING BANK 0 % 02.09.24         | 13.000.000               | EUR     | 13.000.000         | 1,58                         |
| BFCM PPGJ3SQJ 0 %                              |                          |         |                   |                              | LINDE PPGN1KC9 0 %            |                          |         |                    |                              |
| 02/01/2025                                     | 30.000.000               | EUR     | 30.000.000        | 3,65                         | 12/04/2024                    | 1.500.000                | EUR     | 1.497.826          | 0,18                         |
| BNP 0 % 23.05.24                               | 10.000.000               | EUR     | 10.000.000        | 1,22                         | LINFIN 0 % 19.04.24           | 6.000.000                | EUR     | 5.987.169          | 0,73                         |
| BQ POST EUR ESTR                               |                          |         |                   |                              | RABOBK 0 % 03.07.24           | 10.000.000               | EUR     | 10.000.000         | 1,22                         |
| 0 % 30.04.24                                   | 25.000.000               | EUR     | 25.000.000        | 3,04                         |                               |                          |         | <u>30.484.995</u>  | <u>3,71</u>                  |
| BREDBQ PPGGD9M3 0 %                            |                          |         |                   |                              | <b>TOTAL COMMERCIAL PAPER</b> |                          |         |                    |                              |
| 12/06/2024                                     | 5.000.000                | EUR     | 5.000.000         | 0,61                         |                               |                          |         | <b>390.278.040</b> | <b>47,47</b>                 |
| CREDIT AGRICOLE 0 %                            |                          |         |                   |                              | <b>SCHATZWECHSEL</b>          |                          |         |                    |                              |
| 12/09/2024                                     | 1.500.000                | EUR     | 1.500.000         | 0,18                         | <b>FRANKREICH</b>             |                          |         |                    |                              |
|  |                          |         |                   |                              | FRANCE (GOVT) 0 %             |                          |         |                    |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 10/04/2024                    | 6.000.000                | EUR     | 5.995.645          | 0,73                         |
|  |                          |         |                   |                              | FRANCE (GOVT) 0 %             |                          |         |                    |                              |
|  |                          |         |                   |                              | 24.04.24                      | 10.000.000               | EUR     | 9.978.004          | 1,21                         |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Multi-Asset Style Factors (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in EUR)

| Beschreibung                       | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------------------------------|--------------------------|---------|--------------------|------------------------------|
| FRANCE (GOVT) 0 %<br>02/05/2024    | 12.500.000               | EUR     | 12.462.261         | 1,52                         |
| FRANCE (GOVT) 0 %<br>23.05.24      | 32.000.000               | EUR     | 31.831.591         | 3,87                         |
| FRANCE (GOVT) 0 %<br>29.05.24      | 17.000.000               | EUR     | 16.900.125         | 2,06                         |
| FRANCE (GOVT) 0 %<br>12/06/2024    | 4.000.000                | EUR     | 3.970.818          | 0,48                         |
| FRANCE (GOVT) 0 %<br>19.06.24      | 70.000.000               | EUR     | 69.430.213         | 8,45                         |
| FRANCE (GOVT) 0 %<br>24.07.24      | 2.000.000                | EUR     | 1.977.189          | 0,24                         |
| FRANCE (GOVT) 0 %<br>21.08.24      | 35.000.000               | EUR     | 34.498.295         | 4,19                         |
|                                    |                          |         | <b>187.044.141</b> | <b>22,75</b>                 |
| <b>SUMME SCHATZWECHSEL</b>         |                          |         | <b>187.044.141</b> | <b>22,75</b>                 |
| <b>GELDMARKTINSTRUMENTE GESAMT</b> |                          |         | <b>641.168.351</b> | <b>77,99</b>                 |
| <b>SUMME WERTPAPIERANLAGEN</b>     |                          |         | <b>685.634.337</b> | <b>83,40</b>                 |
| <b>SONSTIGES NETTOVERMÖGEN</b>     |                          |         | <b>136.505.648</b> | <b>16,60</b>                 |
| <b>GESAMTNETTOVERMÖGEN</b>         |                          |         | <b>822.139.985</b> | <b>100,00</b>                |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

Multi-Strategy Target Return

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in EUR)

| Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert          | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung                                   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|-------------------|------------------------------|--|--------------------------|---------|----------|------------------------------|
| <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>  |                          |         |                   |                              | <b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>       |                          |         |          |                              |
| <b>AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>               |                          |         |                   |                              | <b>GROSSBRITANNIEN</b>                         |                          |         |          |                              |
| <b>ANLEIHEN</b>   |                          |         |                   |                              | GOLD BULLION SECURITIES                        |                          |         |          |                              |
| <b>AUSTRALIEN</b>   |                          |         |                   |                              | 28.776 USD 5.437.865 4,94                      |                          |         |          |                              |
| AUSTRALIA (GOVT) 0,25 %   |                          |         |                   |                              | <b>5.437.865 4,94</b>                          |                          |         |          |                              |
| 21.11.25  | 3.100.000                | AUD     | 1.769.098         | 1,61                         | <b>LUXEMBURG</b>                               |                          |         |          |                              |
|   |                          |         | <b>1.769.098</b>  | <b>1,61</b>                  | HGIF EURO HIGH YIELD BOND                      |                          |         |          |                              |
| <b>KANADA</b>   |                          |         |                   |                              | 31.013 EUR 1.767.803 1,61                      |                          |         |          |                              |
| CANADA (GOVT) 4,5 %   |                          |         |                   |                              | HGIF GLOBAL EMERGING                           |                          |         |          |                              |
| 01/02/2026  | 2.500.000                | CAD     | 1.720.330         | 1,56                         | MARKETS LOCAL DEBT „ZC“                        |                          |         |          |                              |
|   |                          |         | <b>1.720.330</b>  | <b>1,56</b>                  | 706.274 USD 6.553.306 5,95                     |                          |         |          |                              |
| <b>DEUTSCHLAND</b>  |                          |         |                   |                              | HGIF GLOBAL CORPORATE                          |                          |         |          |                              |
| GERMANY (GOVT) 0,1 %  |                          |         |                   |                              | 121.727 EUR 1.251.354 1,14                     |                          |         |          |                              |
| 15.04.33  | 3.390.000                | EUR     | 3.966.798         | 3,61                         | BOND „ZCHEUR“                                  |                          |         |          |                              |
|   |                          |         | <b>3.966.798</b>  | <b>3,61</b>                  | 217.987 EUR 2.417.258 2,20                     |                          |         |          |                              |
| <b>GROSSBRITANNIEN</b>  |                          |         |                   |                              | <b>SUMME ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b> |                          |         |          |                              |
| UK (GOVT) 1,25 % 22.11.32   | 2.032.000                | GBP     | 4.527.548         | 4,12                         | <b>17.427.586 15,84</b>                        |                          |         |          |                              |
| UK (GOVT) 3,5 % 22.10.25  | 5.000.000                | GBP     | 5.763.050         | 5,24                         | <b>GELDMARKTINSTRUMENTE</b>                    |                          |         |          |                              |
|   |                          |         | <b>10.290.598</b> | <b>9,36</b>                  | <b>SCHATZWECHSEL</b>                           |                          |         |          |                              |
| <b>USA</b>  |                          |         |                   |                              | <b>FRANKREICH</b>                              |                          |         |          |                              |
| US (GOVT) 1,125 % 15.01.33  | 5.165.000                | USD     | 4.647.220         | 4,22                         | FRANCE (GOVT) 0 %                              |                          |         |          |                              |
|   |                          |         | <b>4.647.220</b>  | <b>4,22</b>                  | 10/07/2024                                     |                          |         |          |                              |
| <b>SUMME ANLEIHEN</b>   |                          |         |                   |                              | FRANCE (GOVT) 0 %                              |                          |         |          |                              |
| <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTEN WERTPAPIERE WERTPAPIERE</b>     |                          |         |                   |                              | 26.02.25                                       |                          |         |          |                              |
|   |                          |         | <b>22.394.044</b> | <b>20,36</b>                 | 20.500.000 EUR 19.871.303 18,06                |                          |         |          |                              |
| <b>AN EINEM ANDEREM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE, ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>    |                          |         |                   |                              | <b>SUMME SCHATZWECHSEL</b>                     |                          |         |          |                              |
| <b>ANLEIHEN</b>   |                          |         |                   |                              | <b>37.565.085 34,15</b>                        |                          |         |          |                              |
| <b>ITALIEN</b>  |                          |         |                   |                              | <b>GELDMARKTINSTRUMENTE GESAMT</b>             |                          |         |          |                              |
| ITALY (GOVT) 0,65 %   |                          |         |                   |                              | <b>37.565.085 34,15</b>                        |                          |         |          |                              |
| 15.05.26  | 4.300.000                | EUR     | 4.999.850         | 4,55                         | <b>SUMME WERTPAPIERANLAGEN</b>                 |                          |         |          |                              |
|   |                          |         | <b>4.999.850</b>  | <b>4,55</b>                  | <b>89.036.374 80,94</b>                        |                          |         |          |                              |
| <b>USA</b>  |                          |         |                   |                              | <b>SONSTIGES NETTOVERMÖGEN</b>                 |                          |         |          |                              |
| US (GOVT) 0,625 %   |                          |         |                   |                              | <b>20.963.350 19,06</b>                        |                          |         |          |                              |
| 15.01.26  | 5.700.000                | USD     | 6.649.809         | 6,04                         | <b>GESAMTNETTOVERMÖGEN</b>                     |                          |         |          |                              |
|   |                          |         | <b>6.649.809</b>  | <b>6,04</b>                  | <b>109.999.724 100,00</b>                      |                          |         |          |                              |
| <b>SUMME ANLEIHEN</b>   |                          |         |                   |                              |  |                          |         |          |                              |
| <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN MARKT GEHANDELTEN ÜBERTRAGBAREN WERTPAPIERE</b> |                          |         |                   |                              |  |                          |         |          |                              |
|   |                          |         | <b>11.649.659</b> | <b>10,59</b>                 |  |                          |         |          |                              |
|   |                          |         | <b>11.649.659</b> | <b>10,59</b>                 |  |                          |         |          |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

US Income Focused

Aufstellung der Wertpapiieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung                           | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|------------------|------------------------------|--|--------------------------|---------|-----------|------------------------------|
| <b>WERTPAPIERANLAGEN</b>  |                          |         |                  |                              | CARDINAL HEALTH                        | 879                      | USD     | 98.140    | 0,02                         |
| <b>AN EINER GEREGLTEN BÖRSE NOTIERTE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b> |                          |         |                  |                              | CARETRUST REIT                         | 4.584                    | USD     | 111.850   | 0,02                         |
| <b>AKTIEN</b>   |                          |         |                  |                              | CENTERSPACE                            | 581                      | USD     | 33.152    | 0,01                         |
| <b>IRLAND</b>   |                          |         |                  |                              | CF INDUSTRIES HOLDINGS                 | 10.800                   | USD     | 892.080   | 0,17                         |
| ACCENTURE CORP  | 4.380                    | USD     | 1.502.559        | 0,30                         | CH ROBINSON WORLDWIDE                  | 4.940                    | USD     | 373.464   | 0,07                         |
| MEDTRONIC   | 14.326                   | USD     | 1.247.078        | 0,24                         | CHEVRON                                | 2.905                    | USD     | 457.363   | 0,09                         |
| NEW LINDE   | 45                       | USD     | 20.872           | 0,00                         | CHICAGO MERCANTILE<br>EXCHANGE         | 5.483                    | USD     | 1.183.286 | 0,23                         |
|   |                          |         | <b>2.770.509</b> | <b>0,54</b>                  | CISCO SYSTEMS                          | 32.520                   | USD     | 1.631.854 | 0,32                         |
| <b>USA</b>  |                          |         |                  |                              | CITIZENS FINANCIAL GROUP               | 28.204                   | USD     | 1.017.036 | 0,20                         |
| 3M CO   | 9.789                    |         | 1.033.033        | 0,20                         | COCA-COLA                              | 11.427                   | USD     | 698.133   | 0,14                         |
| ABBOTT LABORATORIES   | 5.739                    | USD     | 649.024          | 0,13                         | COLGATE-PALMOLIVE                      | 12.312                   | USD     | 1.107.218 | 0,22                         |
| ABBVIE  | 11.436                   | USD     | 2.074.605        | 0,41                         | COMCAST                                | 7.154                    | USD     | 309.947   | 0,06                         |
| ADOBE SYSTEMS   | 1.737                    | USD     | 873.086          | 0,17                         | COMMUNITY HEALTHCARE<br>TRUST          | 1.036                    | USD     | 27.319    | 0,01                         |
| ADVANCED MICRO DEVICES  | 5.926                    | USD     | 1.079.243        | 0,21                         | CONAGRA FOODS                          | 2.901                    | USD     | 86.073    | 0,02                         |
| ALEX & BALDWIN  | 2.852                    | USD     | 47.001           | 0,01                         | COSTCO WHOLESALE                       | 2.638                    | USD     | 1.925.687 | 0,38                         |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE<br>REIT                                    | 6.781                    | USD     | 875.834          | 0,17                         | COUSINS PROPERTIES                     | 5.969                    | USD     | 143.017   | 0,03                         |
| ALLSTATE  | 297                      | USD     | 51.345           | 0,01                         | CUBESMART                              | 8.757                    | USD     | 396.955   | 0,08                         |
| ALPHABET „A“  | 15.053                   | USD     | 2.264.874        | 0,44                         | CUMMINS                                | 3.477                    | USD     | 1.023.942 | 0,20                         |
| ALTRIA GROUP  | 28.197                   | USD     | 1.233.337        | 0,24                         | CVS CAREMARK                           | 12.425                   | USD     | 991.018   | 0,19                         |
| AMAZON.COM  | 28.566                   | USD     | 5.159.591        | 1,00                         | DARDEN RESTAURANTS                     | 5.511                    | USD     | 922.927   | 0,18                         |
| AMERICAN ASSETS REIT  | 1.841                    | USD     | 40.465           | 0,01                         | DEVON ENERGY                           | 3.272                    | USD     | 163.404   | 0,03                         |
| AMERICAN HOMES 4 RENT „A“   | 13.014                   | USD     | 478.004          | 0,09                         | DIAMONDBACK ENERGY                     | 1.947                    | USD     | 384.649   | 0,08                         |
| AMERICOLD REALTY TRUST<br>REIT                                    | 11.077                   | USD     | 277.257          | 0,05                         | DIGITAL REALTY TRUST REIT              | 11.800                   | USD     | 1.704.510 | 0,33                         |
| AMERISOURCEBERGEN   | 3.310                    | USD     | 796.916          | 0,16                         | DOMINO'S PIZZA                         | 1.752                    | USD     | 865.821   | 0,17                         |
| AMGEN   | 5.061                    | USD     | 1.449.066        | 0,28                         | DOUGLAS EMMETT                         | 6.199                    | USD     | 86.414    | 0,02                         |
| APARTMENT INCOME REIT   | 5.732                    | USD     | 185.258          | 0,04                         | DOW                                    | 17.433                   | USD     | 1.010.068 | 0,20                         |
| APPLE   | 58.176                   | USD     | 9.954.495        | 1,94                         | EASTERLY GOVERNMENT<br>PROPERTIES REIT | 3.684                    | USD     | 42.255    | 0,01                         |
| APPLE HOSPITALITY REIT  | 8.355                    | USD     | 137.189          | 0,03                         | EASTGROUP PROPERTIES<br>REIT           | 1.791                    | USD     | 321.198   | 0,06                         |
| APPLIED MATERIALS   | 2.223                    | USD     | 457.027          | 0,09                         | EASTMAN CHEMICALS                      | 3.234                    | USD     | 323.012   | 0,06                         |
| ARMADA HOFFLER<br>PROPERTIES                                      | 2.474                    | USD     | 25.779           | 0,01                         | ELI LILLY                              | 1.874                    | USD     | 1.475.887 | 0,29                         |
| AT&T  | 59.758                   | USD     | 1.049.948        | 0,21                         | EQUITY LIFESTYLE<br>PROPERTIES REIT    | 6.957                    | USD     | 448.935   | 0,09                         |
| AVALONBAY COMMUNITIES   | 5.541                    | USD     | 1.030.349        | 0,20                         | EQUITY RESIDENTIAL                     | 14.583                   | USD     | 920.625   | 0,18                         |
| BANK OF AMERICA   | 545                      | USD     | 20.552           | 0,00                         | ESSENTIAL PROPERTIES<br>REALTY REIT    | 6.040                    | USD     | 161.691   | 0,03                         |
| BANK OF NEW YORK MELLON   | 18.395                   | USD     | 1.060.288        | 0,21                         | ESSEX PROPERTY REIT                    | 2.500                    | USD     | 611.025   | 0,12                         |
| BERKSHIRE HATHAWAY „B“  | 4.616                    | USD     | 1.924.272        | 0,38                         | EVEREST RE GROUP                       | 2.048                    | USD     | 815.616   | 0,16                         |
| BEST BUY  | 12.013                   | USD     | 992.634          | 0,19                         | EVERGY INC                             | 16.331                   | USD     | 871.259   | 0,17                         |
| BOSTON PROPERTIES   | 6.130                    | USD     | 398.940          | 0,08                         | EXPEDITOR INTERNATIONAL                | 6.857                    | USD     | 837.583   | 0,16                         |
| BRANDYWINE REALTY TRUST   | 6.268                    | USD     | 29.648           | 0,01                         | EXXON MOBIL                            | 16.796                   | USD     | 1.942.625 | 0,38                         |
| BRISTOL MYERS SQUIBB  | 18.680                   | USD     | 1.010.214        | 0,20                         | FACEBOOK                               | 10.541                   | USD     | 5.139.792 | 1,00                         |
| BRIXMOR PROPERTY GROUP  | 11.719                   | USD     | 275.162          | 0,05                         | FAIR ISSAC                             | 597                      | USD     | 749.856   | 0,15                         |
| BROADCOM CORP   | 2.229                    | USD     | 2.951.196        | 0,58                         | FASTENAL                               | 13.644                   | USD     | 1.057.410 | 0,21                         |
| BROADSTONE NET LEASE  | 7.374                    | USD     | 115.329          | 0,02                         | FEDERAL REALTY<br>INVESTMENT TRUST     | 3.165                    | USD     | 323.621   | 0,06                         |
| BUILDERS FIRSTSOURCE  | 4.752                    | USD     | 998.680          | 0,20                         | FEDEX                                  | 866                      | USD     | 250.023   | 0,05                         |
| CABOT OIL & GAS   | 3.659                    | USD     | 102.013          | 0,02                         | FIFTH THIRD BANCORP                    | 25.704                   | USD     | 954.004   | 0,19                         |
| CAMDEN PROPERTY REIT  | 4.063                    | USD     | 398.865          | 0,08                         | FORD MOTOR                             | 25.613                   | USD     | 339.756   | 0,07                         |
| CAMPBELL SOUP   | 14.671                   | USD     | 653.666          | 0,13                         | FOUR CORNERS PROPERTY                  |                          |         |           |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

US Income Focused (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapiieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung              | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert  | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung              | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert   | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---------------------------|--------------------------|---------|-----------|------------------------------|---------------------------|--------------------------|---------|------------|------------------------------|
| TRUST REIT                | 3.522                    | USD     | 86.042    | 0,02                         | METTLER TOLEDO            |                          |         |            |                              |
| FRANK RESOURCES           | 6.971                    | USD     | 195.258   | 0,04                         | INTERNATIONAL             | 16                       | USD     | 21.478     | 0,00                         |
| GAMING AND LEISURE        |                          |         |           |                              | MICROCHIP TECHNOLOGY      | 5.502                    | USD     | 493.529    | 0,10                         |
| PROPERTIES                | 10.017                   | USD     | 461.383   | 0,09                         | MICROSOFT                 | 28.352                   | USD     | 11.934.774 | 2,33                         |
| GENERAL DYNAMICS          | 2.759                    | USD     | 779.252   | 0,15                         | NATIONAL HEALTH           |                          |         |            |                              |
| GENERAL MILLS             | 11.612                   | USD     | 815.162   | 0,16                         | INVESTORS                 | 1.605                    | USD     | 100.345    | 0,02                         |
| GETTY REALTY REIT         | 1.875                    | USD     | 50.738    | 0,01                         | NATIONAL RETAIL           |                          |         |            |                              |
| GILEAD SCIENCES           | 15.507                   | USD     | 1.141.315 | 0,22                         | PROPERTIES                | 7.103                    | USD     | 303.724    | 0,06                         |
| GLOBAL NET LEASE          | 7.558                    | USD     | 58.877    | 0,01                         | NATIONAL STORAGE          |                          |         |            |                              |
| GOLDMAN SACHS GROUP       | 3.193                    | USD     | 1.330.842 | 0,26                         | AFFILIATES TRUST REIT     | 2.917                    | USD     | 114.405    | 0,02                         |
| HALFMOON PARENT           | 1.025                    | USD     | 373.859   | 0,07                         | NETAPP                    | 9.083                    | USD     | 958.711    | 0,19                         |
| HASBRO                    | 2.581                    | USD     | 145.414   | 0,03                         | NETFLIX                   | 1.856                    | USD     | 1.126.369  | 0,22                         |
| HEALTHCARE REALTY TRUST   | 14.871                   | USD     | 211.168   | 0,04                         | NETSTREIT                 | 2.659                    | USD     | 48.633     | 0,01                         |
| HEALTHPEAK                | 27.656                   | USD     | 517.029   | 0,10                         | NEXPOINT RESIDENTIAL      |                          |         |            |                              |
| HOME DEPOT                | 6.177                    | USD     | 2.365.915 | 0,46                         | TRUST                     | 876                      | USD     | 28.242     | 0,01                         |
| HONEYWELL INTERNATIONAL   | 4.039                    | USD     | 832.519   | 0,16                         | NRG ENERGY                | 9.480                    | USD     | 640.090    | 0,13                         |
| HOST MARRIOTT             | 27.322                   | USD     | 560.374   | 0,11                         | NUCOR                     | 1.235                    | USD     | 244.407    | 0,05                         |
| HP                        | 16.127                   | USD     | 486.713   | 0,10                         | NVIDIA                    | 7.920                    | USD     | 7.190.964  | 1,40                         |
| HUDSON PACIFIC            |                          |         |           |                              | OMNICOM                   | 8.941                    | USD     | 869.244    | 0,17                         |
| PROPERTIES REIT           | 5.309                    | USD     | 34.190    | 0,01                         | OTIS WORLDWIDE            | 3.524                    | USD     | 351.026    | 0,07                         |
| HUNTINGTON BANCSHARES     | 50.781                   | USD     | 705.602   | 0,14                         | PACCAR                    | 9.209                    | USD     | 1.141.456  | 0,22                         |
| IDEXX LABORATORIES        | 469                      | USD     | 254.601   | 0,05                         | PACKAGING CORPORATION     |                          |         |            |                              |
| ILLINOIS TOOL WORKS       | 4.330                    | USD     | 1.161.436 | 0,23                         | OF AMERICA                | 5.070                    | USD     | 962.793    | 0,19                         |
| INDEPENDENCE REALTY       |                          |         |           |                              | PALO ALTO NETWORKS        | 1.319                    | USD     | 374.332    | 0,07                         |
| TRUST REIT                | 8.795                    | USD     | 143.227   | 0,03                         | PARAMOUNT GROUP           | 7.422                    | USD     | 34.958     | 0,01                         |
| INNOVATIVE INDUSTRIAL     |                          |         |           |                              | PAYCHEX                   | 4.797                    | USD     | 587.585    | 0,11                         |
| PROPER REIT               | 1.084                    | USD     | 113.213   | 0,02                         | PEPSICO                   | 1.587                    | USD     | 278.407    | 0,05                         |
| INTERNATIONAL BUSINESS    |                          |         |           |                              | PFIZER                    | 52.290                   | USD     | 1.457.845  | 0,29                         |
| MACHINES                  | 8.026                    | USD     | 1.532.725 | 0,30                         | PHILIP MORRIS             |                          |         |            |                              |
| INTERNATIONAL PAPER       | 21.360                   | USD     | 833.681   | 0,16                         | INTERNATIONAL             | 14.851                   | USD     | 1.363.767  | 0,27                         |
| INTERPUBLIC GROUP         | 25.255                   | USD     | 830.637   | 0,16                         | PHILLIPS EDISON & CO      | 4.664                    | USD     | 166.458    | 0,03                         |
| INVENTRUST PROPERTIES     | 2.577                    | USD     | 66.100    | 0,01                         | PIEDMONT OFFICE REIT „A“  | 4.971                    | USD     | 34.449     | 0,01                         |
| INVITATION HOMES REIT     | 23.893                   | USD     | 844.379   | 0,17                         | PINNACLE WEST CAPITAL     | 10.100                   | USD     | 748.107    | 0,15                         |
| JBG SMITH PROPERTIES REIT | 3.637                    | USD     | 57.974    | 0,01                         | PPL                       | 4.078                    | USD     | 111.656    | 0,02                         |
| JOHNSON & JOHNSON         | 13.212                   | USD     | 2.094.366 | 0,41                         | PRINCIPAL FINANCIAL GROUP | 9.289                    | USD     | 801.362    | 0,16                         |
| JP MORGAN CHASE           | 5.935                    | USD     | 1.184.685 | 0,23                         | PROCTER AND GAMBLE        | 4.707                    | USD     | 763.664    | 0,15                         |
| KENNEDY WILSON HOLDINGS   | 4.777                    | USD     | 40.676    | 0,01                         | PROLOGIS                  | 36.089                   | USD     | 4.664.864  | 0,90                         |
| KEYCORP                   | 24.586                   | USD     | 386.738   | 0,08                         | PRUDENTIAL FINANCIAL      | 8.497                    | USD     | 997.208    | 0,20                         |
| KIMBERLY-CLARK            | 7.845                    | USD     | 1.012.946 | 0,20                         | PUBLIC STORAGE            | 9.291                    | USD     | 2.689.559  | 0,53                         |
| KIMCO REALTY              | 56.666                   | USD     | 1.108.670 | 0,22                         | QUALCOMM                  | 9.498                    | USD     | 1.604.687  | 0,31                         |
| KINDER MORGAN             | 53.684                   | USD     | 979.465   | 0,19                         | QUEST DIAGNOSTICS         | 6.189                    | USD     | 819.238    | 0,16                         |
| KITE REALTY GROUP REIT    | 8.420                    | USD     | 183.051   | 0,04                         | REALTY INCOME             | 43.234                   | USD     | 2.332.690  | 0,46                         |
| KLA TENCOR                | 2.010                    | USD     | 1.402.076 | 0,27                         | REGENCY CENTERS           | 7.075                    | USD     | 428.179    | 0,08                         |
| LABORATORY AMER           | 91                       | USD     | 19.765    | 0,00                         | REGIONS FINANCIAL         | 48.003                   | USD     | 1.004.703  | 0,20                         |
| LAM RESEARCH              | 1.469                    | USD     | 1.429.499 | 0,28                         | REXFORD INDUSTRIAL        |                          |         |            |                              |
| LENNAR                    | 1.416                    | USD     | 244.147   | 0,05                         | REALTY                    | 8.241                    | USD     | 414.522    | 0,08                         |
| LEXINGTON REALTY TRUST    | 11.122                   | USD     | 100.376   | 0,02                         | RLJ LODGING TRUST         | 5.956                    | USD     | 70.519     | 0,01                         |
| LTC PROPERTIES REIT       | 1.592                    | USD     | 51.931    | 0,01                         | ROBERT HALF INTERNATIONAL | 9.970                    | USD     | 784.539    | 0,15                         |
| LYONDELL BASELL           |                          |         |           |                              | ROLLINS                   | 2.625                    | USD     | 121.511    | 0,02                         |
| INDUSTRIES                | 9.095                    | USD     | 933.420   | 0,18                         | ROSS STORES               | 4.809                    | USD     | 709.279    | 0,14                         |
| MACERICH                  | 8.308                    | USD     | 142.482   | 0,03                         | RYMAN HOSPITALITY         |                          |         |            |                              |
| MASTERCARD                | 3.975                    | USD     | 1.908.159 | 0,37                         | PROPERTIES                | 2.266                    | USD     | 263.309    | 0,05                         |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST  | 23.003                   | USD     | 107.884   | 0,02                         | SABRA HEALTHCARE REIT     | 8.898                    | USD     | 131.290    | 0,03                         |
| MERCK & CO                | 15.946                   | USD     | 2.101.523 | 0,41                         | SAFEHOLD                  | 1.815                    | USD     | 37.589     | 0,01                         |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

US Income Focused (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung             | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung                 | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------------|--------------------------|---------|--------------------|------------------------------|------------------------------|--------------------------|---------|------------------|------------------------------|
| SALESFORCE               | 4.432                    | USD     | 1.334.963          | 0,26                         | BOMBARDIER 7,875 %           |                          |         |                  |                              |
| SERVICE PROPERTIES TRUST | 6.573                    | USD     | 44.631             | 0,01                         | 15.04.27                     | 320.000                  | USD     | 320.705          | 0,06                         |
| SIMON PROPERTY GROUP     | 19.672                   | USD     | 3.055.848          | 0,59                         | NOVA CHEMICALS 8,5 %         |                          |         |                  |                              |
| SITE CENTER REIT         | 7.327                    | USD     | 107.157            | 0,02                         | 15.11.28                     | 223.000                  | USD     | 237.692          | 0,05                         |
| SL GREEN REALTY          | 2.491                    | USD     | 136.457            | 0,03                         | WASTE CONNECTIONS 2,2 %      |                          |         |                  |                              |
| SNAP-ON                  | 2.868                    | USD     | 852.742            | 0,17                         | 15.01.32                     | 345.000                  | USD     | 283.294          | 0,06                         |
| SOUTHERN COMFORT         | 13.152                   | USD     | 937.738            | 0,18                         |                              |                          |         | <b>1.118.063</b> | <b>0,22</b>                  |
| STAG INDUSTRIAL REIT     | 7.116                    | USD     | 272.578            | 0,05                         | <b>CHINA</b>                 |                          |         |                  |                              |
| STARBUCKS                | 7.552                    | USD     | 690.857            | 0,14                         | WYNN MACAU 5,5 %             |                          |         |                  |                              |
| STATE STREET             | 6.138                    | USD     | 474.099            | 0,09                         | 01/10/2027                   | 200.000                  | USD     | 191.557          | 0,04                         |
| SUMMIT HOTEL PROPERTIES  |                          |         |                    |                              |                              |                          |         | <b>191.557</b>   | <b>0,04</b>                  |
| REIT                     | 4.240                    | USD     | 27.560             | 0,01                         | <b>FRANKREICH</b>            |                          |         |                  |                              |
| SUN COMMUNITIES REIT     | 4.813                    | USD     | 616.449            | 0,12                         | BNP PARIBAS 5,894 % VRN      |                          |         |                  |                              |
| SYNCHRONY FINANCIAL      | 23.798                   | USD     | 1.021.410          | 0,20                         | 05/12/2034                   | 345.000                  | USD     | 361.265          | 0,07                         |
| TANGER FACTORY OUTLET    |                          |         |                    |                              |                              |                          |         | <b>361.265</b>   | <b>0,07</b>                  |
| CENTRE                   | 4.055                    | USD     | 119.420            | 0,02                         | <b>DEUTSCHLAND</b>           |                          |         |                  |                              |
| TAPESTRY                 | 22.551                   | USD     | 1.064.633          | 0,21                         | DEUTSCHE BANK 2,129 %        |                          |         |                  |                              |
| TERRENO REALTY REIT      | 3.269                    | USD     | 216.604            | 0,04                         | VRN 24.11.26                 | 150.000                  | USD     | 141.585          | 0,03                         |
| TESLA MOTORS             | 5.522                    | USD     | 976.621            | 0,19                         | DEUTSCHE BANK 3,035 %        |                          |         |                  |                              |
| TEXAS INSTRUMENTS        | 6.502                    | USD     | 1.135.054          | 0,22                         | VRN 28.05.32                 | 215.000                  | USD     | 181.581          | 0,03                         |
| THE MOSAIC               | 5.363                    | USD     | 172.099            | 0,03                         |                              |                          |         | <b>323.166</b>   | <b>0,06</b>                  |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC | 72                       | USD     | 41.698             | 0,01                         | <b>GROSSBRITANNIEN</b>       |                          |         |                  |                              |
| TJX                      | 12.799                   | USD     | 1.304.090          | 0,26                         | BARCLAYS 5,69 % VRN          |                          |         |                  |                              |
| TRAVELERS COMPANIES      | 2.902                    | USD     | 667.141            | 0,13                         | 12/03/2030                   | 250.000                  | USD     | 251.397          | 0,05                         |
| UNION PACIFIC            | 765                      | USD     | 188.022            | 0,04                         | BARCLAYS 6,692 % VRN         |                          |         |                  |                              |
| UNITED PARCEL SERVICES   | 8.673                    | USD     | 1.288.114          | 0,25                         | 13.09.34                     | 350.000                  | USD     | 373.672          | 0,07                         |
| UNITEDHEALTH GP          | 2.023                    | USD     | 996.833            | 0,20                         | BARCLAYS 7,325 % VRN         |                          |         |                  |                              |
| URBAN EDGE PROPERTIES    |                          |         |                    |                              | 02/11/2026                   | 815.000                  | USD     | 835.220          | 0,16                         |
| REIT                     | 4.433                    | USD     | 76.070             | 0,01                         | BARCLAYS 8 % VRN PERP        | 747.000                  | USD     | 747.028          | 0,15                         |
| US BANCORP               | 14.421                   | USD     | 644.763            | 0,13                         | BP CAPITAL MARKETS           |                          |         |                  |                              |
| VENTAS                   | 15.619                   | USD     | 679.895            | 0,13                         | 4,375 % VRN PERP             | 49.000                   | USD     | 48.157           | 0,01                         |
| VERIZON COMMUNICATIONS   | 37.339                   | USD     | 1.562.637          | 0,31                         | INEOS QUATTRO FINANCE        |                          |         |                  |                              |
| VIATRIS                  | 28.819                   | USD     | 341.361            | 0,07                         | 9,625 % 15.03.29             | 309.000                  | USD     | 332.859          | 0,07                         |
| VICI PROPERTIES REIT     | 57.492                   | USD     | 1.708.662          | 0,33                         | NATIONWIDE BUILDING SOCIETY  |                          |         |                  |                              |
| VISA „A“                 | 4.835                    | USD     | 1.345.822          | 0,26                         | 6,557 % VRN 18.10.27         | 460.000                  | USD     | 472.280          | 0,09                         |
| VORNADO REALTY TRUST     | 6.920                    | USD     | 197.497            | 0,04                         | NATWEST GROUP 1,642 %        |                          |         |                  |                              |
| WAL MART STORES          | 1.047                    | USD     | 63.333             | 0,01                         | VRN 14.06.27                 | 220.000                  | USD     | 202.422          | 0,04                         |
| WATERS                   | 156                      | USD     | 53.680             | 0,01                         | NATWEST MARKETS 1,6 %        |                          |         |                  |                              |
| WEST PHARMACEUTICAL      |                          |         |                    |                              | 29.09.26                     | 350.000                  | USD     | 320.354          | 0,06                         |
| SERVICES                 | 316                      | USD     | 125.443            | 0,02                         | ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP |                          |         |                  |                              |
| WEYERHAEUSER             | 15.406                   | USD     | 554.154            | 0,11                         | 3,073 % VRN 22.05.28         | 200.000                  | USD     | 186.870          | 0,04                         |
| WILLIAMS COMPANIES       | 11.230                   | USD     | 436.398            | 0,09                         | SANTANDER UK GROUP HOLDINGS  |                          |         |                  |                              |
| WP CAREY REIT            | 8.471                    | USD     | 476.578            | 0,09                         | 2,469 % VRN 11.01.28         | 345.000                  | USD     | 317.180          | 0,06                         |
| XENIA HOTELS AND         |                          |         |                    |                              | STANDARD CHARTERED           |                          |         |                  |                              |
| RESORTS REIT             | 4.171                    | USD     | 62.899             | 0,01                         | 1,822 % 23.11.25             | 800.000                  | USD     | 778.391          | 0,15                         |
|                          |                          |         | <b>186.205.645</b> | <b>36,43</b>                 |                              |                          |         | <b>4.865.830</b> | <b>0,95</b>                  |
| <b>SUMME AKTIEN</b>      |                          |         | <b>188.976.154</b> | <b>36,97</b>                 | <b>IRLAND</b>                |                          |         |                  |                              |
| <b>ANLEIHEN</b>          |                          |         |                    |                              | AERCAP IRELAND CAPITAL       |                          |         |                  |                              |
|                          |                          |         |                    |                              | 4,625 % 15.10.27             | 150.000                  | USD     | 146.422          | 0,03                         |
|                          |                          |         |                    |                              |                              |                          |         | <b>146.422</b>   | <b>0,03</b>                  |
| <b>KANADA</b>            |                          |         |                    |                              |                              |                          |         |                  |                              |
| BOMBARDIER 7,125 %       |                          |         |                    |                              |                              |                          |         |                  |                              |
| 15.06.26                 | 272.000                  | USD     | 276.372            | 0,05                         |                              |                          |         |                  |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

US Income Focused (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung                | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert       | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|-----------------------------|--------------------------|---------|----------------|------------------------------|--|--------------------------|---------|--------------------|------------------------------|
| <b>ITALIEN</b>              |                          |         |                |                              | US (GOVT) 3,625 %  |                          |         |                    |                              |
| UNICREDIT 8 % VRN PERP      | 568.000                  | USD     | 569.076        | 0,11                         | 15.05.53   | 423.000                  | USD     | 372.901            | 0,07                         |
|                             |                          |         | <b>569.076</b> | <b>0,11</b>                  | US (GOVT) 4 % 30.06.28   | 1.260.000                | USD     | 1.247.203          | 0,24                         |
| <b>MACAU</b>                |                          |         |                |                              | US (GOVT) 4 % 31.01.29   |                          |         |                    |                              |
| WYNN MACAU 5,625 %          |                          |         |                |                              | US (GOVT) 4 % 31.01.31   | 1.475.000                | USD     | 1.457.600          | 0,29                         |
| 26.08.28                    | 432.000                  | USD     | 409.793        | 0,08                         | US (GOVT) 4,125 %  |                          |         |                    |                              |
|                             |                          |         | <b>409.793</b> | <b>0,08</b>                  | 31.07.28   | 8.300.000                | USD     | 8.257.528          | 1,62                         |
| <b>NIEDERLANDE</b>          |                          |         |                |                              | US (GOVT) 4,125 %  |                          |         |                    |                              |
| AERCAP HOLDINGS 5,875 %     |                          |         |                |                              | 15.08.53   | 1.440.000                | USD     | 1.388.700          | 0,27                         |
| VRN 10.10.79                | 340.000                  | USD     | 338.191        | 0,07                         | US (GOVT) 4,375 %  |                          |         |                    |                              |
| TRIVIUM PACKAGING           |                          |         |                |                              | 15.12.26   | 2.500.000                | USD     | 2.495.801          | 0,49                         |
| FINANCE 5,5 % 15.08.2026    | 606.000                  | USD     | 596.688        | 0,12                         | US (GOVT) 4,625 %  |                          |         |                    |                              |
|                             |                          |         | <b>934.879</b> | <b>0,19</b>                  | 15.09.26   | 3.000.000                | USD     | 3.008.672          | 0,59                         |
| <b>USA</b>                  |                          |         |                |                              | US (GOVT) 4,625 %  |                          |         |                    |                              |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE      |                          |         |                |                              | 15.11.26   | 3.000.000                | USD     | 3.011.954          | 0,59                         |
| EQUITIES 5,15 % 15.04.2053  | 105.000                  | USD     | 96.803         | 0,02                         | US (GOVT) 4,625 %  |                          |         |                    |                              |
| ARSENAL AIC PARENT          |                          |         |                |                              | 30.09.28   | 4.800.000                | USD     | 4.873.501          | 0,95                         |
| 8 % 01.10.30                | 740.000                  | USD     | 780.506        | 0,15                         | US (GOVT) 4,625 %  |                          |         |                    |                              |
| ASHTREAD CAPITAL 5,95 %     |                          |         |                |                              | 30.09.30   | 1.025.000                | USD     | 1.048.743          | 0,21                         |
| 15.10.33                    | 200.000                  | USD     | 202.475        | 0,04                         | US (GOVT) 4,75 %   |                          |         |                    |                              |
| ELI LILLY 5 % 09.02.2054    | 370.000                  | USD     | 369.168        | 0,07                         | 15.11.43   | 1.050.000                | USD     | 1.092.410          | 0,21                         |
| ENERGY TRANSFER 5,95 %      |                          |         |                |                              | US (GOVT) 4,75 %   |                          |         |                    |                              |
| 15.05.54                    | 265.000                  | USD     | 264.827        | 0,05                         | 15.11.53   | 1.617.000                | USD     | 1.731.453          | 0,34                         |
| ENERGY TRANSFER 6,55 %      |                          |         |                |                              | US (GOVT) 5 % 31.08.25   | 1.500.000                | USD     | 1.503.457          | 0,29                         |
| 01/12/2033                  | 500.000                  | USD     | 536.818        | 0,11                         | US (GOVT) 5 % 31.10.25   | 1.000.000                | USD     | 1.003.281          | 0,20                         |
| EPR PROPERTIES 4,5 %        |                          |         |                |                              |  |                          |         | <b>40.796.047</b>  | <b>7,98</b>                  |
| 01/06/2027                  | 281.000                  | USD     | 267.966        | 0,05                         | <b>SUMME ANLEIHEN</b>  |                          |         | <b>49.716.098</b>  | <b>9,73</b>                  |
| EXELON 5,15 % 15.03.29      | 190.000                  | USD     | 190.546        | 0,04                         | <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>                          |                          |         |                    |                              |
| FORD MOTOR CREDIT           |                          |         |                |                              | <b>USA</b>   |                          |         |                    |                              |
| 6,798 % 07.11.28            | 200.000                  | USD     | 208.861        | 0,04                         | FNMA 2,00 % TBA 15.04.2036                                       | 2.300.000                | USD     | 2.040.712          | 0,40                         |
| GENERAL MOTORS              |                          |         |                |                              | FNMA 2,00 % TBA 15.04.51   | 3.780.000                | USD     | 2.997.011          | 0,58                         |
| FINANCIAL 5,8 % 07.01.29    | 755.000                  | USD     | 769.311        | 0,15                         | FNMA 2,50 % TBA 15.04.51   | 3.370.000                | USD     | 2.792.804          | 0,55                         |
| GENESIS ENERGY 8,875 %      |                          |         |                |                              | GNMA 2,50 % TBA 15.04.2051                                       | 1.290.000                | USD     | 1.102.093          | 0,22                         |
| 15.04.30                    | 545.000                  | USD     | 571.417        | 0,11                         |  |                          |         | <b>8.932.620</b>   | <b>1,75</b>                  |
| HCA 6 % 01.04.54            | 455.000                  | USD     | 463.342        | 0,09                         | <b>SUMME FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>                    |                          |         | <b>8.932.620</b>   | <b>1,75</b>                  |
| HCA 6,1 % 01.04.64          | 615.000                  | USD     | 624.173        | 0,12                         | <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN</b>                              |                          |         |                    |                              |
| MPLX 5,65 % 01.03.53        | 135.000                  | USD     | 132.138        | 0,03                         | <b>BÖRSE NOTIERTEN WERTPAPIERE</b>                               |                          |         |                    |                              |
| ONEMAIN FINANCE 9 %         |                          |         |                |                              |  |                          |         | <b>247.624.872</b> | <b>48,45</b>                 |
| 15.01.29                    | 425.000                  | USD     | 451.346        | 0,09                         | <b>WERTPAPIERE</b>   |                          |         |                    |                              |
| SEMPRA ENERGY 5,5 %         |                          |         |                |                              | <b>AN EINEM ANDEREM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE, ÜBERTRAGBARE</b> |                          |         |                    |                              |
| 01/08/2033                  | 310.000                  | USD     | 311.386        | 0,06                         | <b>WERTPAPIERE</b>   |                          |         |                    |                              |
| SPRINGLEAF FINANCE          |                          |         |                |                              | <b>AKTIEN</b>  |                          |         |                    |                              |
| 5,375 % 15.11.29            | 171.000                  | USD     | 160.972        | 0,03                         | <b>USA</b>   |                          |         |                    |                              |
| SYNCHRONY BANK 5,4 %        |                          |         |                |                              | ALPHABET   | 18.475                   | USD     | 2.802.842          | 0,55                         |
| 22.08.25                    | 375.000                  | USD     | 371.893        | 0,07                         | PARK HOTELS & RESORTS  |                          |         |                    |                              |
| TARGA RESOURCES             |                          |         |                |                              | REIT   | 8.036                    | USD     | 141.594            | 0,03                         |
| PARTNERS 6,15 % 01.03.29    | 510.000                  | USD     | 531.881        | 0,10                         | WELLTOWER  | 21.669                   | USD     | 2.016.517          | 0,39                         |
| TMOBILE 5,5 % 15.01.55      | 105.000                  | USD     | 105.104        | 0,02                         |  |                          |         | <b>4.960.953</b>   | <b>0,97</b>                  |
| TMOBILE 5,75 % 15.01.34     | 180.000                  | USD     | 187.856        | 0,04                         | <b>SUMME AKTIEN</b>  |                          |         | <b>4.960.953</b>   | <b>0,97</b>                  |
| UNITED STATES TREASURY NOTE |                          |         |                |                              |  |                          |         |                    |                              |
| 4,25 % 15.03.27             | 300.000                  | USD     | 298.840        | 0,06                         |  |                          |         |                    |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

US Income Focused (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung             | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung               | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------------|--------------------------|---------|------------------|------------------------------|----------------------------|--------------------------|---------|------------------|------------------------------|
| <b>ANLEIHEN</b>          |                          |         |                  |                              | <b>GROSSBRITANNIEN</b>     |                          |         |                  |                              |
| <b>AUSTRALIEN</b>        |                          |         |                  |                              | MACQUARIE AIRFINANCE       |                          |         |                  |                              |
| FMG RESOURCES 6,125 %    |                          |         |                  |                              | HOLDINGS 6,4 % 26.03.29    | 75.000                   | USD     | 76.227           | 0,01                         |
| 15.04.32                 | 333.000                  | USD     | 329.746          | 0,06                         | MACQUARIE AIRFINANCE       |                          |         |                  |                              |
| MINERAL RESOURCES 8 %    |                          |         |                  |                              | HOLDINGS 6,5 % 26.03.31    | 641.000                  | USD     | 653.285          | 0,13                         |
| 01/11/2027               | 509.000                  | USD     | 519.586          | 0,10                         |                            |                          |         | <b>729.512</b>   | <b>0,14</b>                  |
| MINERAL RESOURCES 8,5 %  |                          |         |                  |                              |                            |                          |         |                  |                              |
| 01/05/2030               | 185.000                  | USD     | 191.005          | 0,04                         | <b>IRLAND</b>              |                          |         |                  |                              |
|                          |                          |         | <b>1.040.337</b> | <b>0,20</b>                  | AIB GROUP 6,608 % VRN      |                          |         |                  |                              |
| <b>BELGIEN</b>           |                          |         |                  |                              | 13.09.29                   | 240.000                  | USD     | 250.378          | 0,05                         |
| KBC GROUP 6,324 % VRN    |                          |         |                  |                              | ARDAGH PACKAGING           |                          |         |                  |                              |
| 21.09.34                 | 375.000                  | USD     | 394.271          | 0,08                         | FINANCE 5,25 % 15.08.27    | 954.000                  | USD     | 603.866          | 0,11                         |
|                          |                          |         | <b>394.271</b>   | <b>0,08</b>                  | AVOLON HOLDINGS FUNDING    |                          |         |                  |                              |
| <b>KANADA</b>            |                          |         |                  |                              | 3,95 % 01.07.24            | 500.000                  | USD     | 497.236          | 0,10                         |
| BC ULC NEW RED           |                          |         |                  |                              |                            |                          |         | <b>1.351.480</b> | <b>0,26</b>                  |
| FINANCE 4,375 % 15.01.28 | 182.000                  | USD     | 172.220          | 0,03                         | <b>ITALIEN</b>             |                          |         |                  |                              |
| BOMBARDIER 7,25 %        |                          |         |                  |                              | INTESA SANPAOLO 4,198 %    |                          |         |                  |                              |
| 01/07/2031               | 80.000                   | USD     | 80.371           | 0,02                         | 01/06/2032                 | 200.000                  | USD     | 167.645          | 0,03                         |
| FIRST QUANTUM MINERALS   |                          |         |                  |                              | INTESA SANPAOLO 6,625 %    |                          |         |                  |                              |
| 6,875 % 15.10.27         | 786.000                  | USD     | 754.410          | 0,14                         | 20.06.33                   | 225.000                  | USD     | 234.158          | 0,05                         |
| FIRST QUANTUM MINERALS   |                          |         |                  |                              | INTESA SANPAOLO 7,2 %      |                          |         |                  |                              |
| 9,375 % 01.03.29         | 342.000                  | USD     | 354.682          | 0,07                         | 28.11.33                   | 280.000                  | USD     | 302.789          | 0,06                         |
| GFL ENVIRONMENTAL 4,75 % |                          |         |                  |                              |                            |                          |         | <b>704.592</b>   | <b>0,14</b>                  |
| 15.06.29                 | 352.000                  | USD     | 331.277          | 0,06                         | <b>JERSEY</b>              |                          |         |                  |                              |
| GFL ENVIRONMENTAL 6,75 % |                          |         |                  |                              | ADIENT GLOBAL HOLDINGS     |                          |         |                  |                              |
| 15.01.31                 | 385.000                  | USD     | 395.348          | 0,08                         | 7 % 15.04.28               | 414.000                  | USD     | 423.804          | 0,08                         |
| HUSKY INJECTION MOLDING  |                          |         |                  |                              | ADIENT GLOBAL HOLDINGS     |                          |         |                  |                              |
| SYSTEMS 9 % 15.02.29     | 326.000                  | USD     | 337.562          | 0,07                         | 8,25 % 15.04.31            | 432.000                  | USD     | 456.392          | 0,09                         |
| NATIONAL BANK OF CANADA  |                          |         |                  |                              |                            |                          |         | <b>880.196</b>   | <b>0,17</b>                  |
| 5,6 % 18.12.28           | 250.000                  | USD     | 254.496          | 0,05                         | <b>LIBERIA</b>             |                          |         |                  |                              |
| NOVA CHEMICALS 9 %       |                          |         |                  |                              | ROYAL CARIBBEAN CRUISES    |                          |         |                  |                              |
| 15.02.30                 | 533.000                  | USD     | 551.047          | 0,11                         | 6,25 % 15.03.32            | 125.000                  | USD     | 126.170          | 0,02                         |
| WASTE CONNECTIONS 4,2 %  |                          |         |                  |                              | ROYAL CARIBBEAN CRUISES    |                          |         |                  |                              |
| 15.01.33                 | 85.000                   | USD     | 80.112           | 0,02                         | 8,25 % 15.01.29            | 250.000                  | USD     | 264.931          | 0,05                         |
|                          |                          |         | <b>3.311.525</b> | <b>0,65</b>                  | ROYAL CARIBBEAN CRUISES    |                          |         |                  |                              |
| <b>FRANKREICH</b>        |                          |         |                  |                              | 9,25 % 15.01.29            | 1.212.000                | USD     | 1.300.686        | 0,26                         |
| ALTICE FRANCE 8,125 %    |                          |         |                  |                              |                            |                          |         | <b>1.691.787</b> | <b>0,33</b>                  |
| 01/02/2027               | 532.000                  | USD     | 411.633          | 0,09                         | <b>LUXEMBURG</b>           |                          |         |                  |                              |
| CREDIT AGRICOLE 6,316 %  |                          |         |                  |                              | ARDAGH METAL PACKAGING     |                          |         |                  |                              |
| VRN 03.10.29             | 315.000                  | USD     | 326.793          | 0,06                         | FINANCE 6 % 15.06.27       | 200.000                  | USD     | 194.828          | 0,04                         |
| ILIAD HOLDING SASU 6,5 % |                          |         |                  |                              |                            |                          |         | <b>194.828</b>   | <b>0,04</b>                  |
| 15.10.26                 | 278.000                  | USD     | 275.622          | 0,05                         | <b>MACAU</b>               |                          |         |                  |                              |
| SOCIETE GENERALE 6,691 % |                          |         |                  |                              | MGM CHINA HOLDINGS         |                          |         |                  |                              |
| VRN 10.01.34             | 200.000                  | USD     | 210.085          | 0,04                         | 5,25 % 18.06.25            | 228.000                  | USD     | 224.909          | 0,04                         |
|                          |                          |         | <b>1.224.133</b> | <b>0,24</b>                  |                            |                          |         | <b>224.909</b>   | <b>0,04</b>                  |
| <b>DEUTSCHLAND</b>       |                          |         |                  |                              | <b>NIEDERLANDE</b>         |                          |         |                  |                              |
| DEUTSCHE BANK 2,311 %    |                          |         |                  |                              | ALCOA NEDERLAND HOLDING    |                          |         |                  |                              |
| VRN 16.11.27             | 480.000                  | USD     | 439.009          | 0,08                         | 7,125 % 15.03.31           | 487.000                  | USD     | 496.552          | 0,10                         |
| DEUTSCHE BANK 3,742 %    |                          |         |                  |                              | COOPERATIEVE RABOBANK      |                          |         |                  |                              |
| VRN 07.01.33             | 485.000                  | USD     | 401.414          | 0,08                         | 3,758 % VRN 06.04.33       | 685.000                  | USD     | 612.941          | 0,12                         |
|                          |                          |         | <b>840.423</b>   | <b>0,16</b>                  | ENEL FINANCE INTERNATIONAL |                          |         |                  |                              |
|                          |                          |         |                  |                              | 5,5 % 15.06.52             | 255.000                  | USD     | 239.958          | 0,05                         |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

US Income Focused (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung                                       | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert         | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung                                     | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--------------------------|---------|------------------|------------------------------|--|--------------------------|---------|-----------|------------------------------|
| ZIGGO BOND 5,125 %<br>28.02.30                     | 1.086.000                | USD     | 930.286          | 0,18                         | AVIATION CAPITAL GROUP<br>1,95 % 30.01.26        | 60.000                   | USD     | 56.058    | 0,01                         |
|  |                          |         | <b>2.279.737</b> | <b>0,45</b>                  | AVIS BUDGET CAR RENTAL<br>8 % 15.02.31           | 684.000                  | USD     | 683.344   | 0,13                         |
| <b>SPANIEN</b>                                     |                          |         |                  |                              | BANK OF AMERICA 2,482 %<br>VRN 21.09.36          | 740.000                  | USD     | 592.059   | 0,12                         |
| GRIFOLS ESCROW ISSUER<br>4,75 % 15.10.28           | 576.000                  | USD     | 477.024          | 0,09                         | BANK OF AMERICA 3,846 %<br>VRN 08.03.37          | 955.000                  | USD     | 847.200   | 0,17                         |
|  |                          |         | <b>477.024</b>   | <b>0,09</b>                  | BANK OF AMERICA 4,571 %<br>VRN 27.04.33          | 175.000                  | USD     | 166.456   | 0,03                         |
| <b>SCHWEIZ</b>                                     |                          |         |                  |                              | BLUE RACER MIDSTREAM<br>7,625 % 15.12.25         | 244.000                  | USD     | 246.568   | 0,05                         |
| CREDIT SUISSE NEW YORK<br>FRN 21.02.25             | 1.815.000                | USD     | 1.823.138        | 0,36                         | BLUE RACER MIDSTREAM<br>FINANCE 6,625 % 15.07.26 | 1.210.000                | USD     | 1.209.394 | 0,24                         |
|  |                          |         | <b>1.823.138</b> | <b>0,36</b>                  | BOARDWALK PIPELINES<br>3,4 % 15.02.31            | 140.000                  | USD     | 124.522   | 0,02                         |
| <b>USA</b>   |                          |         |                  |                              | BRISTOLMYERS SQUIBB<br>5,2 % 22.02.34            | 220.000                  | USD     | 223.864   | 0,04                         |
| AAR ESCROW ISSUER 6,75 %<br>15.03.29               | 189.000                  | USD     | 190.808          | 0,04                         | BROADCOM 3,187 %<br>15.11.36                     | 250.000                  | USD     | 199.421   | 0,04                         |
| ABBVIE 5,4 % 15.03.54                              | 330.000                  | USD     | 340.417          | 0,07                         | BROADCOM 4,15 % 15.04.32                         | 445.000                  | USD     | 413.427   | 0,08                         |
| ADAPTHEALTH 4,625 %<br>01/08/2029                  | 593.000                  | USD     | 510.696          | 0,10                         | BUCKEYE PARTNERS 4,5 %<br>01/03/2028             | 500.000                  | USD     | 475.441   | 0,09                         |
| ADAPTHEALTH 5,125 %<br>01/03/2030                  | 66.000                   | USD     | 57.607           | 0,01                         | BUCKEYE PARTNERS 5,85 %<br>15.11.43              | 514.000                  | USD     | 437.163   | 0,09                         |
| AIRCASTLE 5,25 %<br>11/08/2025                     | 460.000                  | USD     | 455.971          | 0,09                         | BUILDERS FIRSTSOURCE<br>6,375 % 01.03.34         | 538.000                  | USD     | 540.378   | 0,11                         |
| ALLY FINANCIAL 4,7 % VRN<br>PERP                   | 669.000                  | USD     | 532.292          | 0,10                         | CAESARS ENTERTAINMENT<br>6,5 % 15.02.32          | 115.000                  | USD     | 116.197   | 0,02                         |
| AMER SPORTS 6,75 %<br>16.02.31                     | 430.000                  | USD     | 429.237          | 0,08                         | CAESARS ENTERTAINMENT<br>7 % 15.02.30            | 415.000                  | USD     | 426.413   | 0,08                         |
| AMERICAN AIRLINES 8,5 %<br>15.05.29                | 509.000                  | USD     | 537.959          | 0,11                         | CALLON PETROLEUM 7,5 %<br>15.06.30               | 641.000                  | USD     | 679.725   | 0,13                         |
| AMERICAN AIRLINES ADVANTAGE<br>5,75 % 20.04.29     | 1.269.000                | USD     | 1.249.869        | 0,24                         | CALPINE 5 % 01.02.31                             | 400.000                  | USD     | 366.715   | 0,07                         |
| ANTERO MIDSTREAM PARTNERS<br>5,375 % 15.06.29      | 420.000                  | USD     | 404.201          | 0,08                         | CALPINE 5,125 % 15.03.2028                       | 935.000                  | USD     | 898.616   | 0,18                         |
| ANTERO MIDSTREAM PARTNERS<br>5,75 % 15.01.28       | 1.000.000                | USD     | 985.954          | 0,19                         | CAMELOT RETURN MERGER<br>8,75 % 01.08.28         | 775.000                  | USD     | 796.249   | 0,16                         |
| ANTERO RESOURCES 5,375 %<br>01/03/2030             | 406.000                  | USD     | 390.436          | 0,08                         | CARNIVAL HOLDINGS<br>BERMUDA 10,375 % 01.05.2028 | 1.846.000                | USD     | 2.015.649 | 0,38                         |
| ANTERO RESOURCES 7,625 %<br>01/02/2029             | 250.000                  | USD     | 257.438          | 0,05                         | CCO HOLDINGS 4,75 %<br>01/03/2030                | 1.116.000                | USD     | 960.564   | 0,19                         |
| ANTERO RESOURCES 8,375 %<br>15.07.26               | 776.000                  | USD     | 806.997          | 0,16                         | CCO HOLDINGS 5,375 %<br>01/06/2029               | 1.253.000                | USD     | 1.147.485 | 0,22                         |
| ARCHROCK PARTNERS 6,25 %<br>01/04/2028             | 650.000                  | USD     | 643.525          | 0,13                         | CCO HOLDINGS 7,375 %<br>01/03/2031               | 606.000                  | USD     | 594.781   | 0,12                         |
| ARDAGH PACKAGING<br>FINANCE 4,125 % 15.08.2026     | 375.000                  | USD     | 340.743          | 0,07                         | CENTENE 3 % 15.10.30                             | 25.000                   | USD     | 21.456    | 0,00                         |
| ARSENAL AIC PARENT<br>11,5 % 01.10.31              | 459.000                  | USD     | 512.724          | 0,10                         | CENTRAL PARENT 7,25 %<br>15.06.29                | 698.000                  | USD     | 713.537   | 0,14                         |
| ASCENT RESOURCES UTICA<br>HOLDINGS 8,25 % 31.12.28 | 438.000                  | USD     | 450.303          | 0,09                         | CHART INDUSTRIES 7,5 %<br>01/01/2030             | 539.000                  | USD     | 560.277   | 0,11                         |
| ASHTON WOODS USA 4,625 %<br>01/08/2029             | 787.000                  | USD     | 726.992          | 0,14                         | CHART INDUSTRIES 9,5 %<br>01/01/2031             | 196.000                  | USD     | 213.917   | 0,04                         |
| AVIATION CAPITAL GROUP<br>1,95 % 20.09.26          | 520.000                  | USD     | 475.604          | 0,09                         |  |                          |         |           |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

US Income Focused (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert  | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--------------------------|---------|-----------|------------------------------|--|--------------------------|---------|-----------|------------------------------|
| CHARTER COMMUNICATIONS<br>OPERATING 3,5 % 01.06.2041 | 45.000                   | USD     | 30.383    | 0,01                         | EQT MIDSTREAM PARTNERS<br>5,5 % 15.07.28             | 425.000                  | USD     | 418.812   | 0,08                         |
| CHARTER COMMUNICATIONS<br>OPERATING 3,5 % 01.03.42   | 795.000                  | USD     | 532.783   | 0,10                         | EQM MIDSTREAM PARTNERS<br>7,5 % 01.06.30             | 447.000                  | USD     | 478.490   | 0,09                         |
| CHSCOMMUNITY HEALTH<br>SYSTEMS 6,125 % 01.04.30      | 250.000                  | USD     | 180.280   | 0,04                         | ESAB 6,25 % 15.04.29                                 | 231.000                  | USD     | 232.412   | 0,05                         |
| CHSCOMMUNITY HEALTH<br>SYSTEMS 8 % 15.03.2026        | 713.000                  | USD     | 711.378   | 0,14                         | FERTITTA ENTERTAINMENT<br>6,75 % 15.07.30            | 398.000                  | USD     | 358.717   | 0,07                         |
| CINEMARK 5,875 %<br>15.03.26                         | 721.000                  | USD     | 712.987   | 0,14                         | FORD MOTOR CREDIT 6,05 %<br>05/03/2031               | 475.000                  | USD     | 479.390   | 0,09                         |
| CIVITAS RESOURCES<br>8,375 % 01.07.28                | 800.000                  | USD     | 844.918   | 0,17                         | FORTREA HOLDINGS 7,5 %<br>01/07/2030                 | 482.000                  | USD     | 498.367   | 0,10                         |
| CIVITAS RESOURCES<br>8,625 % 01.11.30                | 122.000                  | USD     | 131.067   | 0,03                         | FREEDOM MORTGAGE<br>HOLDINGS 9,25 % 01.02.29         | 160.000                  | USD     | 163.915   | 0,03                         |
| CIVITAS RESOURCES 8,75 %<br>01/07/2031               | 285.000                  | USD     | 305.670   | 0,06                         | FRONTIER COMMUNICATIONS<br>5,875 % 15.10.27          | 747.000                  | USD     | 724.077   | 0,14                         |
| CLEVELANDCLIFFS 5,875 %<br>01/06/2027                | 422.000                  | USD     | 422.363   | 0,08                         | GEN DIGITAL 7,125 %<br>30.09.30                      | 547.000                  | USD     | 562.366   | 0,11                         |
| CLEVELANDCLIFFS 6,75 %<br>15.04.30                   | 850.000                  | USD     | 854.794   | 0,17                         | GLP CAPITAL 5,75 %<br>01/06/2028                     | 144.000                  | USD     | 144.422   | 0,03                         |
| CLEVELANDCLIFFS 7 %<br>15.03.32                      | 235.000                  | USD     | 238.391   | 0,05                         | GLP CAPITAL LP GLP<br>FINANCING 6,75 % 01.12.33      | 540.000                  | USD     | 569.646   | 0,11                         |
| CLOUD SOFTWARE 6,5 %<br>31.03.29                     | 574.000                  | USD     | 545.054   | 0,11                         | GPC MERGER 7,125 %<br>15.08.28                       | 1.115.000                | USD     | 1.012.796 | 0,20                         |
| CLYDESDALE ACQUISITION<br>HOLDINGS 6,625 % 15.04.29  | 602.000                  | USD     | 603.293   | 0,12                         | GRAY ESCROW 7 %<br>15.05.27                          | 148.000                  | USD     | 137.905   | 0,03                         |
| CLYDESDALE ACQUISITION<br>HOLDINGS 8,75 % 15.04.30   | 510.000                  | USD     | 501.797   | 0,10                         | GRAY TELEVISION 5,875 %<br>15.07.26                  | 400.000                  | USD     | 389.472   | 0,08                         |
| COLGATE ENERGY PARTNERS<br>5,875 % 01.07.29          | 837.000                  | USD     | 823.771   | 0,16                         | HERC HOLDINGS 5,5 %<br>15.07.27                      | 315.000                  | USD     | 309.957   | 0,06                         |
| CORNERSTONE BUILDING<br>BRANDS 6,125 % 15.01.29      | 249.000                  | USD     | 223.000   | 0,04                         | HILTON GRAND VACATIONS BORROWER<br>6,625 % 15.01.32  | 341.000                  | USD     | 342.304   | 0,07                         |
| CSC HOLDINGS 11,25 %<br>15.05.28                     | 1.037.000                | USD     | 1.028.889 | 0,20                         | IQVIA 6,5 % 15.05.30                                 | 200.000                  | USD     | 204.298   | 0,04                         |
| DAE FUNDING 1,55 %<br>01/08/2024                     | 215.000                  | USD     | 211.889   | 0,04                         | IRON MOUNTAIN 5,25 %<br>15.07.30                     | 344.000                  | USD     | 326.279   | 0,06                         |
| DAVE BUSTERS 7,625 %<br>01/11/2025                   | 700.000                  | USD     | 705.899   | 0,14                         | IRON MOUNTAIN 7 %<br>15.02.29                        | 750.000                  | USD     | 765.116   | 0,15                         |
| DELL INTERNATIONAL<br>6,02 % 15.06.26                | 186.000                  | USD     | 188.560   | 0,04                         | JACKSON FINANCIAL<br>3,125 % 23.11.31                | 190.000                  | USD     | 158.760   | 0,03                         |
| DIRECTV HOLDINGS 5,875 %<br>15.08.27                 | 425.000                  | USD     | 402.457   | 0,08                         | JACKSON NATIONAL LIFE GLOBAL<br>FUND 1,75 % 12.01.25 | 400.000                  | USD     | 388.054   | 0,08                         |
| DISH NETWORK 11,75 %<br>15.11.27                     | 300.000                  | USD     | 306.683   | 0,06                         | JEFFERIES FINANCE 5 %<br>15.08.28                    | 383.000                  | USD     | 352.720   | 0,07                         |
| EMERALD DEBT MERGER<br>6,625 % 15.12.30              | 348.000                  | USD     | 352.041   | 0,07                         | JELD WEN 4,875 %<br>15.12.27                         | 600.000                  | USD     | 575.567   | 0,11                         |
| ENLINK MIDSTREAM 6,5 %<br>01/09/2030                 | 681.000                  | USD     | 700.782   | 0,14                         | JPMORGAN CHASE 0,824 %<br>VRN 01.06.25               | 500.000                  | USD     | 495.752   | 0,10                         |
| EPR PROPERTIES 3,6 %<br>15.11.31                     | 540.000                  | USD     | 452.363   | 0,09                         | JPMORGAN CHASE 5 % VRN<br>PERP                       | 500.000                  | USD     | 499.220   | 0,10                         |
| EPR PROPERTIES 4,75 %<br>15.12.26                    | 300.000                  | USD     | 290.688   | 0,06                         | KAISER ALUMINUM 4,625 %<br>01/03/2028                | 400.000                  | USD     | 376.344   | 0,07                         |
|  |                          |         |           |                              | KENNAMETAL 2,8 %<br>01/03/2031                       | 35.000                   | USD     | 29.745    | 0,01                         |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



## Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

US Income Focused (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert  | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|-----------|------------------------------|---|--------------------------|---------|-----------|------------------------------|
| KINETIK HOLDINGS 5,875 %<br>15.06.30                | 882.000                  | USD     | 863.658   | 0,17                         | PERMIAN RESOURCES<br>OPERATING 7 % 15.01.32         | 700.000                  | USD     | 726.186   | 0,14                         |
| KODIAK GAS SERVICES<br>7,25 % 15.02.29              | 103.000                  | USD     | 105.054   | 0,02                         | PETSMART FINANCE 7,75 %<br>15.02.29                 | 1.216.000                | USD     | 1.185.423 | 0,23                         |
| LABL 9,5 % 01.11.28                                 | 1.095.000                | USD     | 1.110.246 | 0,22                         | POST HOLDINGS 4,625 %<br>15.04.30                   | 500.000                  | USD     | 460.097   | 0,09                         |
| LEVEL 3 FINANCING 10,5 %<br>15.05.30                | 636.000                  | USD     | 657.421   | 0,13                         | PRAIRIE ACQUIROR 9 %<br>01/08/2029                  | 234.000                  | USD     | 241.697   | 0,05                         |
| LIFEPOINT HEALTH 9,875 %<br>15.08.30                | 753.000                  | USD     | 788.399   | 0,15                         | PRESIDIO HOLDINGS 8,25 %<br>01/02/2028              | 636.000                  | USD     | 635.617   | 0,12                         |
| MACYS RETAIL HOLDINGS<br>5,875 % 01.04.29           | 939.000                  | USD     | 922.253   | 0,18                         | PRIME SECURITY SERVICES BORROWER<br>6,25 % 15.01.28 | 308.000                  | USD     | 302.106   | 0,06                         |
| MCAFEE 7,375 % 15.02.30                             | 433.000                  | USD     | 399.844   | 0,08                         | RITHM CAPITAL 8 %<br>01/04/2029                     | 661.000                  | USD     | 641.751   | 0,13                         |
| MEDLINE BORROWER LPMEDLINE<br>6,25 % 01.04.29       | 472.000                  | USD     | 474.706   | 0,09                         | SEAGATE 8,25 % 15.12.29                             | 474.000                  | USD     | 510.326   | 0,10                         |
| METROPOLITAN LIFE GLOBAL<br>FUNDING 0,55 % 07.06.24 | 925.000                  | USD     | 916.694   | 0,18                         | SEALED AIR 6,125 %<br>01/02/2028                    | 276.000                  | USD     | 277.013   | 0,05                         |
| MGM RESORTS INTERNATIONAL<br>6,5 % 15.04.32         | 645.000                  | USD     | 644.398   | 0,13                         | SERVICE PROPERTIES<br>TRUST 7,5 % 15.09.25          | 776.000                  | USD     | 786.556   | 0,15                         |
| MILEAGE PLUS HOLDINGS<br>6,5 % 20.06.27             | 566.000                  | USD     | 399.294   | 0,08                         | SERVICE PROPERTIES<br>TRUST 8,625 % 15.11.31        | 409.000                  | USD     | 436.644   | 0,09                         |
| MODIVCARE ESCROW ISSUER<br>5 % 01.10.29             | 593.000                  | USD     | 430.677   | 0,08                         | SIRIUS XM RADIO 5 %<br>01/08/2027                   | 660.000                  | USD     | 636.431   | 0,12                         |
| MORGAN STANLEY 2,484 %<br>VRN 16.09.36              | 310.000                  | USD     | 245.349   | 0,05                         | SIRIUS XM RADIO 5,5 %<br>01/07/2029                 | 244.000                  | USD     | 233.141   | 0,05                         |
| MOZART DEBT MERGER<br>3,875 % 01.04.29              | 650.000                  | USD     | 592.708   | 0,12                         | SPRINGLEAF FINANCE<br>7,125 % 15.03.26              | 350.000                  | USD     | 356.879   | 0,07                         |
| MSCI 3,875 % 15.02.31                               | 241.000                  | USD     | 215.396   | 0,04                         | STANDARD INDUSTRIES<br>4,75 % 15.01.28              | 683.000                  | USD     | 652.810   | 0,13                         |
| NATIONSTAR MORTGAGE<br>HOLDINGS 5,5 % 15.08.28      | 650.000                  | USD     | 622.858   | 0,12                         | SUMMIT MATERIALS 7,25 %<br>15.01.31                 | 126.000                  | USD     | 131.070   | 0,03                         |
| NATIONSTAR MORTGAGE<br>HOLDINGS 5,75 % 15.11.31     | 737.000                  | USD     | 680.516   | 0,13                         | SUNOCO 7 % 15.09.28                                 | 402.000                  | USD     | 411.312   | 0,08                         |
| NATIONSTAR MORTGAGE<br>HOLDINGS 7,125 % 01.02.32    | 111.000                  | USD     | 110.496   | 0,02                         | SURGERY CENTER HOLDINGS<br>7,25 % 15.04.32          | 469.000                  | USD     | 472.261   | 0,09                         |
| NAVIENT 6,75 % 15.06.2026                           | 985.000                  | USD     | 994.791   | 0,19                         | SYNCHRONY FINANCIAL<br>2,875 % 28.10.31             | 309.000                  | USD     | 247.488   | 0,05                         |
| NCL 8,125 % 15.01.29                                | 1.280.000                | USD     | 1.357.668 | 0,27                         | SYNCHRONY FINANCIAL<br>4,875 % 13.06.25             | 860.000                  | USD     | 847.716   | 0,17                         |
| NCL 8,375 % 01.02.28                                | 202.000                  | USD     | 213.604   | 0,04                         | TALLGRASS ENERGY<br>PARTNERS 6 % 01.03.2027         | 371.000                  | USD     | 365.516   | 0,07                         |
| NCR 5 % 01.10.28                                    | 382.000                  | USD     | 356.625   | 0,07                         | TALLGRASS ENERGY<br>PARTNERS 6 % 31.12.30           | 300.000                  | USD     | 285.178   | 0,06                         |
| NCR 5,125 % 15.04.29                                | 51.000                   | USD     | 47.346    | 0,01                         | TALLGRASS ENERGY<br>PARTNERS 7,375 % 15.02.29       | 424.000                  | USD     | 426.739   | 0,08                         |
| NCR ATLEOS ESCROW 9,5 %<br>01/04/2029               | 551.000                  | USD     | 589.711   | 0,12                         | TENET HEALTHCARE 6,125 %<br>01/10/2028              | 1.194.000                | USD     | 1.191.900 | 0,23                         |
| OPEN TEXT HOLDINGS<br>4,125 % 01.12.31              | 415.000                  | USD     | 364.252   | 0,07                         | TRANSDIGM 6,625 %<br>01/03/2032                     | 635.000                  | USD     | 641.893   | 0,13                         |
| OWENS MINOR 6,625 %<br>01/04/2030                   | 440.000                  | USD     | 437.204   | 0,09                         | TRANSDIGM 6,75 %<br>15.08.28                        | 1.000.000                | USD     | 1.015.927 | 0,20                         |
| PACTIV EVERGREEN GROUP<br>ISSUER 4,375 % 15.10.28   | 630.000                  | USD     | 588.733   | 0,12                         |   |                          |         |           |                              |
| PANTHER BF AGGREGATOR<br>8,5 % 15.05.27             | 662.000                  | USD     | 663.378   | 0,13                         |   |                          |         |           |                              |
| PENNYMAC FINANCIAL<br>SERVICES 5,75 % 15.09.31      | 1.140.000                | USD     | 1.060.048 | 0,21                         |   |                          |         |           |                              |
| PENNYMAC FINANCIAL SERVICES<br>7,875 % 15.12.29     | 267.000                  | USD     | 274.675   | 0,05                         |   |                          |         |           |                              |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

US Income Focused (Fortsetzung)

Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024

(in USD)

| Beschreibung                            | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>vermögens | Beschreibung                                  | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert           | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--------------------------|---------|--------------------|------------------------------|---|--------------------------|---------|--------------------|------------------------------|
| TRANSDIGM 7,125 %                       |                          |         |                    |                              | FNMA 4,00 % TBA 15.04.51                      | 1.020.000                | USD     | 946.767            | 0,19                         |
| 01/12/2031                              | 159.000                  | USD     | 164.121            | 0,03                         | FNMA 4,50 % TBA 15.04.51                      | 380.000                  | USD     | 362.451            | 0,07                         |
| TRONOX 4,625 % 15.03.29                 | 861.000                  | USD     | 773.798            | 0,15                         | FNMA 5,00 % TBA 15.04.35                      | 480.000                  | USD     | 469.278            | 0,09                         |
| UBER TECHNOLOGIES 8 %                   |                          |         |                    |                              | FNMA 5,00 % TBA 15.04.2036                    | 1.870.000                | USD     | 1.863.164          | 0,36                         |
| 01/11/2026                              | 345.000                  | USD     | 349.427            | 0,07                         | FNMA 6,00 % TBA 15.04.35                      | 1.060.000                | USD     | 1.070.897          | 0,21                         |
| UNITED RENTALS NORTH                    |                          |         |                    |                              | FNMA 6,50 % TBA 15.04.35                      | 1.300.000                | USD     | 1.329.033          | 0,26                         |
| AMERICA 5,25 % 15.01.30                 | 769.000                  | USD     | 751.562            | 0,15                         | GINNIE MAE 2,00 % TBA 15.04.2051              | 1.730.000                | USD     | 1.420.304          | 0,28                         |
| US (GOVT) 1,75 % 15.08.41               | 3.086.000                | USD     | 2.089.801          | 0,40                         | GNMA 3,00 % TBA 15.04.2051                    | 1.240.000                | USD     | 1.096.192          | 0,21                         |
| US (GOVT) 2 % 15.11.41                  | 2.200.000                | USD     | 1.548.766          | 0,29                         | GNMA 3,50 % TBA 15.04.2051                    | 1.500.000                | USD     | 1.368.117          | 0,27                         |
| US (GOVT) 4 % 15.02.34                  | 4.093.000                | USD     | 4.031.925          | 0,78                         | GNMA 4,00 % TBA 15.04.2051                    | 1.080.000                | USD     | 1.013.259          | 0,20                         |
| US (GOVT) 4,25 %                        |                          |         |                    |                              | GNMA 4,50 % TBA 15.04.49                      | 210.000                  | USD     | 202.002            | 0,04                         |
| 28.02.29                                | 2.730.000                | USD     | 2.736.292          | 0,53                         | GNMA 5,50 % TBA 15.04.54                      | 650.000                  | USD     | 650.016            | 0,13                         |
| VENTURE GLOBAL 8,125 %                  |                          |         |                    |                              |   |                          |         | <b>18.857.697</b>  | <b>3,69</b>                  |
| 01/06/2028                              | 1.331.000                | USD     | 1.360.754          | 0,27                         | <b>SUMME FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b> |                          |         | <b>18.857.697</b>  | <b>3,69</b>                  |
| VENTURE GLOBAL 9,875 %                  |                          |         |                    |                              |   |                          |         |                    |                              |
| 01/02/2032                              | 126.000                  | USD     | 135.999            | 0,03                         | <b>SUMME DER AN EINER GEREGLTEN</b>           |                          |         | <b>141.487.266</b> | <b>27,68</b>                 |
| VENTURE GLOBAL CALCASIEU                |                          |         |                    |                              | <b>MARKT GEHANDELTEN ÜBERTRAGBAREN</b>        |                          |         |                    |                              |
| PASS 6,25 % 15.01.30                    | 76.000                   | USD     | 76.548             | 0,01                         | <b>WERTPAPIERE</b>                            |                          |         |                    |                              |
| VICI PROPERTIES 4,625 %                 |                          |         |                    |                              | <b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>      |                          |         |                    |                              |
| 01/12/2029                              | 476.000                  | USD     | 450.510            | 0,09                         | <b>IRLAND</b>                                 |                          |         |                    |                              |
| VIKING CRUISES 9,125 %                  |                          |         |                    |                              | HSBC GLOBAL LIQUIDITY                         |                          |         |                    |                              |
| 15.07.31                                | 286.000                  | USD     | 313.313            | 0,06                         | FUND  | 17                       | USD     | 17                 | 0,00                         |
| VIKING OCEAN CRUISES                    |                          |         |                    |                              | ISHARES \$ HIGH YIELD                         |                          |         |                    |                              |
| 5,625 % 15.02.29                        | 860.000                  | USD     | 839.022            | 0,16                         | CORPORATE BOND ETF                            | 39.830                   | USD     | 3.754.774          | 0,73                         |
| VINE ENERGY HOLDINGS                    |                          |         |                    |                              | XTRACKERS MSCI USA                            |                          |         |                    |                              |
| 6,75 % 15.04.29                         | 567.000                  | USD     | 573.795            | 0,11                         | INFORMATION UCITS ETF                         | 53.176                   | USD     | 5.034.172          | 0,99                         |
| VISTRA 7 % VRN PERP                     | 224.000                  | USD     | 222.024            | 0,04                         |   |                          |         | <b>8.788.963</b>   | <b>1,72</b>                  |
| VISTRA 8 % VRN PERP                     | 638.000                  | USD     | 651.528            | 0,13                         | <b>LUXEMBURG</b>                              |                          |         |                    |                              |
| WAND NEWCO 7,625 %                      |                          |         |                    |                              | HGIF ASIA HY BOND „ZC“*                       | -                        | USD     | -                  | 0,00                         |
| 30.01.32                                | 340.000                  | USD     | 352.156            | 0,07                         | HGIF GLOBAL ASSET                             |                          |         |                    |                              |
| WARNERMEDIA HOLDINGS                    |                          |         |                    |                              | BACKED BOND „Z“                               | 6.534                    | USD     | 1.124.044          | 0,22                         |
| 5,05 % 15.03.42                         | 410.000                  | USD     | 352.607            | 0,07                         | HGIF US HIGH YIELD                            |                          |         |                    |                              |
| WASH MULTIFAMILY ACQUISITION            |                          |         |                    |                              | BOND „ZC“                                     | 2.469.531                | USD     | 30.330.776         | 5,93                         |
| 5,75 % 15.04.26                         | 675.000                  | USD     | 661.067            | 0,13                         | STRUC INVEST SICAV                            |                          |         |                    |                              |
| WR GRACE HOLDINGS                       |                          |         |                    |                              | GLOBAL ENHANCED EQUITY                        |                          |         |                    |                              |
| 5,625 % 15.08.29                        | 482.000                  | USD     | 431.948            | 0,08                         | E USD   | 6.677.577                | USD     | 76.813.504         | 15,03                        |
| WR GRACE HOLDINGS                       |                          |         |                    |                              |   |                          |         | <b>108.268.324</b> | <b>21,18</b>                 |
| 7,375 % 01.03.31                        | 440.000                  | USD     | 446.954            | 0,09                         | <b>USA</b>                                    |                          |         |                    |                              |
| WYNDHAM DESTINATIONS                    |                          |         |                    |                              | ACADIA REALTY TRUST                           | 3.893                    | USD     | 65.870             | 0,01                         |
| 4,625 % 01.03.30                        | 672.000                  | USD     | 615.396            | 0,12                         | AGREE REALTY CORP                             | 3.860                    | USD     | 219.981            | 0,04                         |
|   |                          |         | <b>100.500.724</b> | <b>19,67</b>                 | CORPORATE OFFICE                              |                          |         |                    |                              |
| <b>SUMME ANLEIHEN</b>                   |                          |         | <b>117.668.616</b> | <b>23,02</b>                 | PROPERTIES                                    | 4.424                    | USD     | 107.017            | 0,02                         |
|   |                          |         |                    |                              | EPR PROPERTIES                                | 2.905                    | USD     | 123.172            | 0,02                         |
| <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b> |                          |         |                    |                              | EXTRA SPACE STORAGE                           | 8.166                    | USD     | 1.203.423          | 0,25                         |
| <b>USA</b>                              |                          |         |                    |                              | FIRST INDUSTRIAL REALTY                       |                          |         |                    |                              |
| FNMA 1,50 % TBA 15.04.2036              | 1.420.000                | USD     | 1.231.518          | 0,24                         | TRUST   | 5.167                    | USD     | 272.611            | 0,05                         |
| FNMA 1,50 % TBA 15.04.51                | 1.500.000                | USD     | 1.131.869          | 0,22                         | HIGHWOODS PROPERTIES                          | 4.032                    | USD     | 105.114            | 0,02                         |
| FNMA 2,50 % TBA 15.04.2036              | 1.710.000                | USD     | 1.556.861          | 0,30                         | KILROY REALTY                                 | 4.596                    | USD     | 167.869            | 0,03                         |
| FNMA 3,00 % TBA 15.04.51                | 2.160.000                | USD     | 1.863.595          | 0,37                         | MIDAMERICA APARTMENT                          | 4.547                    | USD     | 598.476            | 0,12                         |
| FNMA 3,50 % TBA 15.04.51                | 1.430.000                | USD     | 1.282.374          | 0,25                         |   |                          |         |                    |                              |

\*Die im Anlagenportfolio gehaltene Anzahl beträgt 0,01 Anteile.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## Aufstellung der Wertpapierbestände und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2024

US Income Focused (Fortsetzung)  
Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. März 2024  
(in USD)

| Beschreibung   | Anzahl/<br>Nenn-<br>wert | Währung | Kurswert            | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--------------------------|---------|---------------------|------------------------------|
| OMEGA HEALTHCARE<br>INVESTORS  | 9.581                    | USD     | 299.885             | 0,06                         |
| RETAIL OPPORTUNITY<br>WERTPAPIERANLAGEN<br>SUNSTONE HOTEL<br>INVESTORS | 4.780                    | USD     | 61.280              | 0,01                         |
| UDR  | 8.008                    | USD     | 89.169              | 0,02                         |
| WASHINGTON REAL ESTATE   | 12.848                   | USD     | 480.644             | 0,09                         |
|  | 3.299                    | USD     | 45.823              | 0,01                         |
|  |                          |         | <b>3.840.334</b>    | <b>0,75</b>                  |
| <b>SUMME ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>                         |                          |         | <b>120.897.621</b>  | <b>23,65</b>                 |
| <b>GELDMARKTINSTRUMENTE</b>  |                          |         |                     |                              |
| <b>SCHATZWECHSEL</b>   |                          |         |                     |                              |
| <b>USA</b>   |                          |         |                     |                              |
| US (GOVT) 0 % 02.05.24   | 13.950.000               | USD     | 13.886.664          | 2,72                         |
|  |                          |         | <b>13.886.664</b>   | <b>2,72</b>                  |
| <b>SUMME SCHATZWECHSEL</b>   |                          |         | <b>13.886.664</b>   | <b>2,72</b>                  |
| <b>GELDMARKTINSTRUMENTE GESAMT</b>                                     |                          |         | <b>13.886.664</b>   | <b>2,72</b>                  |
| <b>SUMME WERTPAPIERANLAGEN</b>   |                          |         | <b>523.896.423</b>  | <b>102,50</b>                |
| <b>SONSTIGE NETTOVERBINDLICHKEITEN</b>                                 |                          |         | <b>(12.790.859)</b> | <b>(2,50)</b>                |
| <b>GESAMTNETTOVERMÖGEN</b>   |                          |         | <b>511.105.564</b>  | <b>100,00</b>                |

Die begleitenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024

## Devisenterminkontrakte

Am 31. März 2024 hat die Gesellschaft zur Absicherung des Portfolios und der entsprechenden Anteilklassen verschiedene Devisenterminkontrakte abgeschlossen, die sie an bestimmten Terminen zur Lieferung von Devisen verpflichten. Es bestehen die folgenden offenen Kontrakte:

| Teilfonds   | Im Austausch für | Erfüllungstermin | Währung | Kontrakt zur Lieferung | Kontrahent    | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|---|------------------|------------------|---------|------------------------|---------------|--|
| <b>Asia ex Japan Equity</b>                       |                  |                  |         |                        |               |  |
| USD   | 72.014           | 30.04.2024       | EUR     | 66.474                 | HSBC Bank PLC | 138  |
| USD   | 48.887           | 30.04.2024       | EUR     | 44.985                 | HSBC Bank PLC | 246  |
| USD   | 2.859            | 30.04.2024       | EUR     | 2.631                  | HSBC Bank PLC | 14   |
| USD   | 14.749           | 30.04.2024       | EUR     | 13.601                 | HSBC Bank PLC | 43   |
| USD   | 4.214            | 30.04.2024       | EUR     | 3.890                  | HSBC Bank PLC | 8  |
| USD   | 17.579           | 30.04.2024       | EUR     | 16.227                 | HSBC Bank PLC | 34   |
| USD   | 11.829           | 30.04.2024       | EUR     | 10.885                 | HSBC Bank PLC | 60   |
| <b>USD</b>  |                  |                  |         |                        |               | <b>543</b>   |
| EUR   | 7.707.352        | 30.04.2024       | USD     | 8.423.935              | HSBC Bank PLC | (90.313)   |
| EUR   | 146.775          | 30.04.2024       | USD     | 158.980                | HSBC Bank PLC | (278)  |
| EUR   | 1.894            | 30.04.2024       | USD     | 2.051                  | HSBC Bank PLC | (4)  |
| EUR   | 50.288           | 30.04.2024       | USD     | 54.514                 | HSBC Bank PLC | (140)  |
| USD   | 46.369           | 30.04.2024       | EUR     | 42.988                 | HSBC Bank PLC | (113)  |
| EUR   | 451.061          | 30.04.2024       | USD     | 492.998                | HSBC Bank PLC | (5.285)  |
| EUR   | 8.571            | 30.04.2024       | USD     | 9.284                  | HSBC Bank PLC | (16)   |
| EUR   | 2.942            | 30.04.2024       | USD     | 3.189                  | HSBC Bank PLC | (8)  |
| USD   | 2.787            | 30.04.2024       | EUR     | 2.583                  | HSBC Bank PLC | (7)  |
| EUR   | 1.885.995        | 30.04.2024       | USD     | 2.061.344              | HSBC Bank PLC | (22.100)   |
| EUR   | 35.954           | 30.04.2024       | USD     | 38.944                 | HSBC Bank PLC | (68)   |
| EUR   | 12.342           | 30.04.2024       | USD     | 13.380                 | HSBC Bank PLC | (34)   |
| USD   | 11.303           | 30.04.2024       | EUR     | 10.479                 | HSBC Bank PLC | (27)   |
| <b>USD</b>  |                  |                  |         |                        |               | <b>(118.393)</b>   |
| <b>Asia Pacific ex Japan Equity High Dividend</b> |                  |                  |         |                        |               |  |
| CNH   | 757.286          | 30.04.2024       | USD     | 104.365                | HSBC Bank PLC | 36   |
| USD   | 61.698           | 30.04.2024       | CNH     | 446.679                | HSBC Bank PLC | 118  |
| USD   | 461.116          | 30.04.2024       | CNH     | 3.336.227              | HSBC Bank PLC | 1.175  |
| USD   | 36.526           | 30.04.2024       | CNH     | 264.279                | HSBC Bank PLC | 92   |
| <b>USD</b>  |                  |                  |         |                        |               | <b>1.421</b>   |
| CNH   | 34.760.992       | 30.04.2024       | USD     | 4.833.589              | HSBC Bank PLC | (41.353)   |
| USD   | 33.448           | 30.04.2024       | CNH     | 242.788                | HSBC Bank PLC | (23)   |
| <b>USD</b>  |                  |                  |         |                        |               | <b>(41.376)</b>  |
| <b>Euroland Equity Smaller Companies</b>          |                  |                  |         |                        |               |  |
| USD   | 42.352           | 30.04.2024       | EUR     | 38.757                 | HSBC Bank PLC | 414  |
| USD   | 425              | 30.04.2024       | EUR     | 393                    | HSBC Bank PLC | 1  |
| USD   | 221              | 30.04.2024       | EUR     | 204                    | HSBC Bank PLC | -  |
| <b>USD</b>  |                  |                  |         |                        |               | <b>415</b>   |
| <b>Euroland Value</b>                             |                  |                  |         |                        |               |  |
| USD   | 53.031           | 30.04.2024       | EUR     | 48.529                 | HSBC Bank PLC | 518  |
| USD   | 374              | 30.04.2024       | EUR     | 346                    | HSBC Bank PLC | 1  |
| USD   | 5.098            | 30.04.2024       | EUR     | 4.698                  | HSBC Bank PLC | 17   |
| USD   | 338              | 30.04.2024       | EUR     | 311                    | HSBC Bank PLC | 2  |
| USD   | 1.522            | 30.04.2024       | EUR     | 1.404                  | HSBC Bank PLC | 4  |
| USD   | 2.871.925        | 30.04.2024       | EUR     | 2.628.134              | HSBC Bank PLC | 28.072   |
| USD   | 20.180           | 30.04.2024       | EUR     | 18.634                 | HSBC Bank PLC | 30   |
| USD   | 21.884           | 30.04.2024       | EUR     | 20.207                 | HSBC Bank PLC | 33   |
| USD   | 252.288          | 30.04.2024       | EUR     | 232.484                | HSBC Bank PLC | 854  |
| USD   | 18.378           | 30.04.2024       | EUR     | 16.911                 | HSBC Bank PLC | 86   |
| <b>EUR</b>  |                  |                  |         |                        |               | <b>29.617</b>  |

# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

| Teilfonds                           | Im Austausch für | Erfüllungstermin | Währung | Kontrakt zur Lieferung | Kontrahent    | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|-------------------------------------|------------------|------------------|---------|------------------------|---------------|--|
| <b>Euroland Value (Fortsetzung)</b> |                  |                  |         |                        |               |  |
| EUR                                 | 1.608            | 30.04.2024       | USD     | 1.741                  | HSBC Bank PLC | (3)  |
| USD                                 | 588              | 30.04.2024       | EUR     | 545                    | HSBC Bank PLC | -  |
| EUR                                 | 273.451          | 30.04.2024       | USD     | 296.745                | HSBC Bank PLC | (1.005)  |
| EUR                                 | 59.130           | 30.04.2024       | USD     | 64.112                 | HSBC Bank PLC | (166)  |
| USD                                 | 26.606           | 30.04.2024       | EUR     | 24.666                 | HSBC Bank PLC | (59)   |
| <b>EUR</b>                          |                  |                  |         |                        |               | <b>(1.233)</b>   |
| <b>Global Equity Climate Change</b> |                  |                  |         |                        |               |  |
| USD                                 | 392              | 30.04.2024       | EUR     | 361                    | HSBC Bank PLC | 2  |
| GBP                                 | 2.059            | 30.04.2024       | USD     | 2.592                  | HSBC Bank PLC | 9  |
| USD                                 | 3.266            | 30.04.2024       | GBP     | 2.581                  | HSBC Bank PLC | 7  |
| USD                                 | 2.098            | 30.04.2024       | SGD     | 2.820                  | HSBC Bank PLC | 5  |
| USD                                 | 2.237            | 30.04.2024       | SGD     | 3.002                  | HSBC Bank PLC | 9  |
| USD                                 | 17               | 30.04.2024       | SGD     | 23                     | HSBC Bank PLC | -  |
| USD                                 | 8                | 30.04.2024       | SGD     | 11                     | HSBC Bank PLC | -  |
| AUD                                 | 404              | 30.04.2024       | USD     | 263                    | HSBC Bank PLC | -  |
| USD                                 | 343              | 30.04.2024       | AUD     | 524                    | HSBC Bank PLC | 1  |
| <b>USD</b>                          |                  |                  |         |                        |               | <b>33</b>  |
| EUR                                 | 34.695           | 30.04.2024       | USD     | 37.920                 | HSBC Bank PLC | (407)  |
| EUR                                 | 280              | 30.04.2024       | USD     | 303                    | HSBC Bank PLC | (1)  |
| GBP                                 | 250.158          | 30.04.2024       | USD     | 319.597                | HSBC Bank PLC | (3.537)  |
| SGD                                 | 552.752          | 30.04.2024       | USD     | 413.538                | HSBC Bank PLC | (3.437)  |
| SGD                                 | 3.400            | 30.04.2024       | USD     | 2.534                  | HSBC Bank PLC | (11)   |
| SGD                                 | 4.412            | 30.04.2024       | USD     | 3.277                  | HSBC Bank PLC | (3)  |
| HKD                                 | 6.740            | 30.04.2024       | USD     | 863                    | HSBC Bank PLC | (1)  |
| HKD                                 | 55               | 30.04.2024       | USD     | 7                      | HSBC Bank PLC | -  |
| USD                                 | 4                | 30.04.2024       | HKD     | 34                     | HSBC Bank PLC | -  |
| USD                                 | 5                | 30.04.2024       | HKD     | 36                     | HSBC Bank PLC | -  |
| AUD                                 | 50.413           | 30.04.2024       | USD     | 33.353                 | HSBC Bank PLC | (438)  |
| <b>USD</b>                          |                  |                  |         |                        |               | <b>(7.835)</b>   |
| <b>Global Real Estate Equity</b>    |                  |                  |         |                        |               |  |
| USD                                 | 597              | 30.04.2024       | SGD     | 802                    | HSBC Bank PLC | 2  |
| USD                                 | 729              | 30.04.2024       | SGD     | 981                    | HSBC Bank PLC | -  |
| SGD                                 | 1.051            | 30.04.2024       | USD     | 779                    | HSBC Bank PLC | 1  |
| <b>USD</b>                          |                  |                  |         |                        |               | <b>3</b>   |
| SGD                                 | 154.196          | 30.04.2024       | USD     | 115.361                | HSBC Bank PLC | (958)  |
| SGD                                 | 2.072            | 30.04.2024       | USD     | 1.545                  | HSBC Bank PLC | (7)  |
| SGD                                 | 2.285            | 30.04.2024       | USD     | 1.697                  | HSBC Bank PLC | (1)  |
| SGD                                 | 550              | 30.04.2024       | USD     | 408                    | HSBC Bank PLC | -  |
| SGD                                 | 500              | 30.04.2024       | USD     | 372                    | HSBC Bank PLC | (1)  |
| SGD                                 | 992              | 30.04.2024       | USD     | 736                    | HSBC Bank PLC | -  |
| <b>USD</b>                          |                  |                  |         |                        |               | <b>(967)</b>   |

# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

| Teilfonds                                   | Im Austausch für | Erfüllungstermin | Währung | Kontrakt zur Lieferung | Kontrahent    | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|---|------------------|------------------|---------|------------------------|---------------|--|
| <b>Global Equity Sustainable Healthcare</b> |                  |                  |         |                        |               |  |
| USD   | 3.465            | 30.04.2024       | EUR     | 3.198                  | HSBC Bank PLC | 7  |
| EUR   | 2.077            | 30.04.2024       | USD     | 2.240                  | HSBC Bank PLC | 5  |
| GBP   | 5.681            | 30.04.2024       | USD     | 7.151                  | HSBC Bank PLC | 26   |
| GBP   | 59.400           | 30.04.2024       | USD     | 74.866                 | HSBC Bank PLC | 182  |
| GBP   | 29.106           | 30.04.2024       | USD     | 36.759                 | HSBC Bank PLC | 14   |
| GBP   | 5.796            | 30.04.2024       | USD     | 7.300                  | HSBC Bank PLC | 23   |
| GBP   | 273              | 30.04.2024       | USD     | 343                    | HSBC Bank PLC | 1  |
| GBP   | 332              | 30.04.2024       | USD     | 418                    | HSBC Bank PLC | 1  |
| GBP   | 2.125            | 30.04.2024       | USD     | 2.675                  | HSBC Bank PLC | 10   |
| GBP   | 854              | 30.04.2024       | USD     | 1.078                  | HSBC Bank PLC | -  |
| GBP   | 1.005            | 30.04.2024       | USD     | 1.266                  | HSBC Bank PLC | 4  |
| USD   | 6.132            | 30.04.2024       | SGD     | 8.244                  | HSBC Bank PLC | 16   |
| SGD   | 5.376            | 30.04.2024       | USD     | 3.984                  | HSBC Bank PLC | 5  |
| AUD   | 61.201           | 30.04.2024       | USD     | 39.908                 | HSBC Bank PLC | 51   |
| USD   | 28.753           | 30.04.2024       | AUD     | 44.001                 | HSBC Bank PLC | 25   |
| AUD   | 29.081           | 30.04.2024       | USD     | 18.882                 | HSBC Bank PLC | 105  |
|   |                  |                  |         |                        | <b>USD</b>    | <b>475</b>   |
| EUR   | 342.016          | 30.04.2024       | USD     | 373.815                | HSBC Bank PLC | (4.008)  |
| EUR   | 4.447            | 30.04.2024       | USD     | 4.816                  | HSBC Bank PLC | (8)  |
| EUR   | 1.776            | 30.04.2024       | USD     | 1.925                  | HSBC Bank PLC | (5)  |
| EUR   | 8.900.722        | 30.04.2024       | USD     | 9.641.280              | HSBC Bank PLC | (17.318)   |
| GBP   | 431.854          | 30.04.2024       | USD     | 551.728                | HSBC Bank PLC | (6.107)  |
| USD   | 5.077            | 30.04.2024       | GBP     | 4.024                  | HSBC Bank PLC | (7)  |
| GBP   | 20.715           | 30.04.2024       | USD     | 26.465                 | HSBC Bank PLC | (293)  |
| USD   | 244              | 30.04.2024       | GBP     | 193                    | HSBC Bank PLC | -  |
| GBP   | 10.000           | 30.04.2024       | USD     | 12.646                 | HSBC Bank PLC | (13)   |
| GBP   | 161.268          | 30.04.2024       | USD     | 206.032                | HSBC Bank PLC | (2.280)  |
| USD   | 1.892            | 30.04.2024       | GBP     | 1.499                  | HSBC Bank PLC | (2)  |
| SGD   | 875.703          | 30.04.2024       | USD     | 655.152                | HSBC Bank PLC | (5.444)  |
| SGD   | 11.297           | 30.04.2024       | USD     | 8.391                  | HSBC Bank PLC | (9)  |
| SGD   | 4.519            | 30.04.2024       | USD     | 3.358                  | HSBC Bank PLC | (5)  |
| SGD   | 200              | 30.04.2024       | USD     | 149                    | HSBC Bank PLC | -  |
| AUD   | 4.717.328        | 30.04.2024       | USD     | 3.120.970              | HSBC Bank PLC | (41.007)   |
| AUD   | 24.175           | 30.04.2024       | USD     | 15.789                 | HSBC Bank PLC | (5)  |
|   |                  |                  |         |                        | <b>USD</b>    | <b>(76.511)</b>  |
| <b>Global Infrastructure Equity</b>         |                  |                  |         |                        |               |  |
| GBP   | 89.137           | 30.04.2024       | USD     | 113.879                | HSBC Bank PLC | (1.261)  |
| CNH   | 17.195           | 30.04.2024       | USD     | 2.391                  | HSBC Bank PLC | (20)   |
| CNH   | 5.157.090        | 30.04.2024       | USD     | 717.104                | HSBC Bank PLC | (6.135)  |
| GBP   | 890              | 30.04.2024       | USD     | 1.137                  | HSBC Bank PLC | (13)   |
| AUD   | 1.604            | 30.04.2024       | USD     | 1.061                  | HSBC Bank PLC | (14)   |
| AUD   | 290.895          | 30.04.2024       | USD     | 192.455                | HSBC Bank PLC | (2.529)  |
| EUR   | 1.003            | 30.04.2024       | USD     | 1.097                  | HSBC Bank PLC | (12)   |
| GBP   | 756.927          | 30.04.2024       | USD     | 967.035                | HSBC Bank PLC | (10.703)   |
| GBP   | 1.004            | 30.04.2024       | USD     | 1.272                  | HSBC Bank PLC | (4)  |
| EUR   | 12.418.283       | 30.04.2024       | USD     | 13.572.861             | HSBC Bank PLC | (145.514)  |
| EUR   | 1.733            | 30.04.2024       | USD     | 1.885                  | HSBC Bank PLC | (11)   |
| EUR   | 17.608           | 30.04.2024       | USD     | 19.072                 | HSBC Bank PLC | (33)   |
| EUR   | 64.053           | 30.04.2024       | USD     | 69.519                 | HSBC Bank PLC | (261)  |
| EUR   | 69.490           | 30.04.2024       | USD     | 75.951                 | HSBC Bank PLC | (814)  |
|   |                  |                  |         |                        | <b>USD</b>    | <b>(167.324)</b>   |

# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

| Teilfonds                               | Im Austausch für | Erfüllungstermin | Währung | Kontrakt zur Lieferung | Kontrahent    | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|---|------------------|------------------|---------|------------------------|---------------|--|
| <b>Global Equity Volatility Focused</b> |                  |                  |         |                        |               |  |
| USD                                     | 1.601            | 30.04.2024       | EUR     | 1.473                  | HSBC Bank PLC | 8  |
| USD                                     | 8.561            | 30.04.2024       | EUR     | 7.878                  | HSBC Bank PLC | 43   |
| USD                                     | 7.670            | 30.04.2024       | SGD     | 10.290                 | HSBC Bank PLC | 36   |
| USD                                     | 22.756           | 30.04.2024       | SGD     | 30.545                 | HSBC Bank PLC | 94   |
| USD                                     | 118              | 30.04.2024       | SGD     | 158                    | HSBC Bank PLC | -  |
| USD                                     | 167              | 30.04.2024       | SGD     | 225                    | HSBC Bank PLC | -  |
| USD                                     | 10.053           | 30.04.2024       | SGD     | 13.493                 | HSBC Bank PLC | 42   |
| USD                                     | 40.441           | 30.04.2024       | SGD     | 54.355                 | HSBC Bank PLC | 113  |
| CNH                                     | 428.452          | 30.04.2024       | USD     | 59.047                 | HSBC Bank PLC | 20   |
| USD                                     | 37.905           | 30.04.2024       | CNH     | 274.258                | HSBC Bank PLC | 95   |
| USD                                     | 52.503           | 30.04.2024       | CNH     | 379.914                | HSBC Bank PLC | 127  |
| AUD                                     | 3.790            | 30.04.2024       | USD     | 2.471                  | HSBC Bank PLC | 3  |
| USD                                     | 1.358            | 30.04.2024       | AUD     | 2.071                  | HSBC Bank PLC | 6  |
| USD                                     | 8.810            | 30.04.2024       | AUD     | 13.466                 | HSBC Bank PLC | 18   |
| AUD                                     | 78.287           | 30.04.2024       | USD     | 51.049                 | HSBC Bank PLC | 65   |
| AUD                                     | 976              | 30.04.2024       | USD     | 637                    | HSBC Bank PLC | -  |
| USD                                     | 28.047           | 30.04.2024       | AUD     | 42.771                 | HSBC Bank PLC | 122  |
| CAD                                     | 54.763           | 30.04.2024       | USD     | 40.367                 | HSBC Bank PLC | 117  |
| CAD                                     | 412              | 30.04.2024       | USD     | 304                    | HSBC Bank PLC | 1  |
|   |                  |                  |         |                        | <b>USD</b>    | <b>910</b>   |
| EUR                                     | 250.012          | 30.04.2024       | USD     | 273.256                | HSBC Bank PLC | (2.930)  |
| EUR                                     | 2.706            | 30.04.2024       | USD     | 2.931                  | HSBC Bank PLC | (5)  |
| EUR                                     | 1.336.691        | 30.04.2024       | USD     | 1.460.968              | HSBC Bank PLC | (15.663)   |
| EUR                                     | 14.466           | 30.04.2024       | USD     | 15.669                 | HSBC Bank PLC | (27)   |
| SGD                                     | 5.119.519        | 30.04.2024       | USD     | 3.830.140              | HSBC Bank PLC | (31.830)   |
| SGD                                     | 54.954           | 30.04.2024       | USD     | 40.817                 | HSBC Bank PLC | (44)   |
| SGD                                     | 11.703           | 30.04.2024       | USD     | 8.686                  | HSBC Bank PLC | (3)  |
| SGD                                     | 1.138            | 30.04.2024       | USD     | 847                    | HSBC Bank PLC | (2)  |
| SGD                                     | 2.259.436        | 30.04.2024       | USD     | 1.690.384              | HSBC Bank PLC | (14.047)   |
| SGD                                     | 24.252           | 30.04.2024       | USD     | 18.013                 | HSBC Bank PLC | (20)   |
| CNH                                     | 40.142.738       | 30.04.2024       | USD     | 5.581.932              | HSBC Bank PLC | (47.755)   |
| AUD                                     | 352.709          | 30.04.2024       | USD     | 233.351                | HSBC Bank PLC | (3.066)  |
| AUD                                     | 7.283.931        | 30.04.2024       | USD     | 4.819.027              | HSBC Bank PLC | (63.318)   |
| CAD                                     | 5.056.781        | 30.04.2024       | USD     | 3.751.605              | HSBC Bank PLC | (13.303)   |
| USD                                     | 22.023           | 30.04.2024       | CAD     | 29.874                 | HSBC Bank PLC | (62)   |
| USD                                     | 125.183          | 30.04.2024       | CAD     | 169.800                | HSBC Bank PLC | (344)  |
|   |                  |                  |         |                        | <b>USD</b>    | <b>(192.419)</b>   |

# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

| Teilfonds                       | Im Austausch für | Erfüllungstermin | Währung | Kontrakt zur Lieferung | Kontrahent                               | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|---------------------------------|------------------|------------------|---------|------------------------|--|--|
| <b>Economic Scale US Equity</b> |                  |                  |         |                        |  |  |
| USD                             | 68.168           | 30.04.2024       | EUR     | 62.935                 | HSBC Bank PLC                            | 120  |
| USD                             | 236.678          | 30.04.2024       | EUR     | 218.473                | HSBC Bank PLC                            | 454  |
| USD                             | 24.827           | 30.04.2024       | EUR     | 22.875                 | HSBC Bank PLC                            | 93   |
| USD                             | 4.505            | 30.04.2024       | EUR     | 4.158                  | HSBC Bank PLC                            | 9  |
| USD                             | 183              | 30.04.2024       | EUR     | 169                    | HSBC Bank PLC                            | -  |
| USD                             | 1.729            | 30.04.2024       | EUR     | 1.596                  | HSBC Bank PLC                            | 3  |
| USD                             | 111              | 30.04.2024       | EUR     | 102                    | HSBC Bank PLC                            | -  |
|                                 |                  |                  |         |                        | <b>USD</b>                               | <b>679</b>   |
| EUR                             | 38.259.968       | 30.04.2024       | USD     | 41.817.150             | HSBC Bank PLC                            | (448.319)  |
| EUR                             | 633.005          | 30.04.2024       | USD     | 685.640                | HSBC Bank PLC                            | (1.198)  |
| EUR                             | 212.898          | 30.04.2024       | USD     | 230.867                | HSBC Bank PLC                            | (669)  |
| EUR                             | 30.066           | 30.04.2024       | USD     | 32.568                 | HSBC Bank PLC                            | (59)   |
| EUR                             | 728.172          | 30.04.2024       | USD     | 795.873                | HSBC Bank PLC                            | (8.533)  |
| EUR                             | 12.055           | 30.04.2024       | USD     | 13.058                 | HSBC Bank PLC                            | (23)   |
| EUR                             | 29.543           | 30.04.2024       | USD     | 32.290                 | HSBC Bank PLC                            | (346)  |
| EUR                             | 489              | 30.04.2024       | USD     | 530                    | HSBC Bank PLC                            | (1)  |
| EUR                             | 280.124          | 30.04.2024       | USD     | 306.168                | HSBC Bank PLC                            | (3.282)  |
| EUR                             | 4.636            | 30.04.2024       | USD     | 5.022                  | HSBC Bank PLC                            | (9)  |
| EUR                             | 17.939           | 30.04.2024       | USD     | 19.607                 | HSBC Bank PLC                            | (210)  |
| EUR                             | 297              | 30.04.2024       | USD     | 322                    | HSBC Bank PLC                            | (1)  |
|                                 |                  |                  |         |                        | <b>USD</b>                               | <b>(462.650)</b>   |
| <b>Asia Bond</b>                |                  |                  |         |                        |  |  |
| USD                             | 1.339.464        | 28/06/2024       | EUR     | 1.230.000              | BNP Paribas                              | 6.285  |
| USD                             | 15.709           | 30.04.2024       | EUR     | 14.442                 | HSBC Bank PLC                            | 94   |
| USD                             | 86.829           | 30.04.2024       | EUR     | 80.160                 | HSBC Bank PLC                            | 156  |
| USD                             | 3.282            | 30.04.2024       | EUR     | 3.030                  | HSBC Bank PLC                            | 6  |
| USD                             | 9.034            | 30.04.2024       | EUR     | 8.340                  | HSBC Bank PLC                            | 16   |
| USD                             | 423.285          | 30.04.2024       | EUR     | 390.340                | HSBC Bank PLC                            | 1.227  |
| EUR                             | 130.187          | 30.04.2024       | USD     | 140.426                | HSBC Bank PLC                            | 340  |
| GBP                             | 3.577            | 30.04.2024       | USD     | 4.509                  | HSBC Bank PLC                            | 11   |
| GBP                             | 33.545           | 30.04.2024       | USD     | 42.369                 | HSBC Bank PLC                            | 12   |
| USD                             | 6                | 30.04.2024       | SGD     | 8                      | HSBC Bank PLC                            | -  |
| USD                             | 691.459          | 28/06/2024       | EUR     | 632.000                | BNP Paribas                              | 6.442  |
| USD                             | 962.211          | 28/06/2024       | EUR     | 875.000                | Crédit Agricole                          | 13.811   |
| USD                             | 2.936.190        | 28/06/2024       | KRW     | 3.845.000.000          | HSBC Bank PLC                            | 72.826   |
| USD                             | 953.800          | 28/06/2024       | THB     | 33.600.000             | UBS                                      | 26.253   |
| USD                             | 5.737.711        | 28/06/2024       | JPY     | 830.000.000            | State Street Bank and Trust Co, Hongkong | 179.806  |
| USD                             | 946.190          | 28/06/2024       | CNY     | 6.750.000              | Westpac Banking Sydney                   | 2.662  |
| USD                             | 962.475          | 28/06/2024       | KRW     | 1.260.000.000          | State Street Bank and Trust Co, Hongkong | 24.155   |
| USD                             | 959.407          | 28/06/2024       | THB     | 34.000.000             | BNP Paribas                              | 20.818   |
| USD                             | 958.473          | 28/06/2024       | THB     | 34.000.000             | UBS                                      | 19.884   |
| USD                             | 920.626          | 28/06/2024       | EUR     | 838.000                | Crédit Agricole                          | 12.330   |
| USD                             | 953.839          | 28/06/2024       | PHP     | 53.000.000             | BNP Paribas                              | 11.773   |
| USD                             | 951.246          | 28/06/2024       | THB     | 34.000.000             | Merrill Lynch International Bank         | 12.657   |
| USD                             | 952.362          | 28/06/2024       | PHP     | 53.000.000             | HSBC Bank PLC                            | 10.296   |
| USD                             | 381.346          | 30.04.2024       | JPY     | 57.000.000             | Crédit Agricole                          | 3.055  |
| USD                             | 1.006.648        | 28/06/2024       | EUR     | 917.000                | BNP Paribas                              | 12.725   |
| USD                             | 5.762.937        | 28/06/2024       | EUR     | 5.250.000              | State Street Bank and Trust Co, Hongkong | 72.537   |
| USD                             | 968.888          | 28/06/2024       | EUR     | 886.000                | BNP Paribas                              | 8.566  |
| THB                             | 34.000.000       | 28/06/2024       | USD     | 938.451                | UBS                                      | 138  |
| THB                             | 33.600.000       | 28/06/2024       | USD     | 927.411                | UBS                                      | 136  |
|                                 |                  |                  |         |                        | <b>USD</b>                               | <b>519.017</b>   |



# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

| Teilfonds                      | Im Austausch für | Erfüllungstermin | Währung | Kontrakt zur Lieferung | Kontrahent                               | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|--------------------------------|------------------|------------------|---------|------------------------|--|--|
| <b>Asia Bond (Fortsetzung)</b> |                  |                  |         |                        |  |  |
| EUR                            | 903.906          | 30.04.2024       | USD     | 987.946                | HSBC Bank PLC                            | (10.592)   |
| EUR                            | 163.563          | 30.04.2024       | USD     | 178.770                | HSBC Bank PLC                            | (1.917)  |
| EUR                            | 7.243.691        | 30.04.2024       | USD     | 7.917.166              | HSBC Bank PLC                            | (84.879)   |
| EUR                            | 12.328.140       | 30.04.2024       | USD     | 13.474.337             | HSBC Bank PLC                            | (144.457)  |
| EUR                            | 9.563            | 30.04.2024       | USD     | 10.379                 | HSBC Bank PLC                            | (39)   |
| EUR                            | 8.049            | 30.04.2024       | USD     | 8.729                  | HSBC Bank PLC                            | (25)   |
| EUR                            | 45.072           | 30.04.2024       | USD     | 48.822                 | HSBC Bank PLC                            | (88)   |
| USD                            | 102.020          | 30.04.2024       | EUR     | 94.582                 | HSBC Bank PLC                            | (247)  |
| EUR                            | 22.704.219       | 30.04.2024       | USD     | 24.815.121             | HSBC Bank PLC                            | (266.041)  |
| EUR                            | 25.731.149       | 30.04.2024       | USD     | 28.123.477             | HSBC Bank PLC                            | (301.510)  |
| EUR                            | 16.338           | 30.04.2024       | USD     | 17.772                 | HSBC Bank PLC                            | (106)  |
| EUR                            | 36.448           | 30.04.2024       | USD     | 39.480                 | HSBC Bank PLC                            | (71)   |
| GBP                            | 127.833.017      | 30.04.2024       | USD     | 163.316.906            | HSBC Bank PLC                            | (1.807.620)  |
| GBP                            | 30.401           | 30.04.2024       | USD     | 38.516                 | HSBC Bank PLC                            | (106)  |
| GBP                            | 10.035           | 30.04.2024       | USD     | 12.690                 | HSBC Bank PLC                            | (12)   |
| USD                            | 21.527           | 30.04.2024       | GBP     | 17.045                 | HSBC Bank PLC                            | (8)  |
| USD                            | 1.181.859        | 30.04.2024       | GBP     | 938.351                | HSBC Bank PLC                            | (3.691)  |
| CHF                            | 793.799          | 30.04.2024       | USD     | 890.879                | HSBC Bank PLC                            | (6.929)  |
| USD                            | 7.995            | 30.04.2024       | CHF     | 7.224                  | HSBC Bank PLC                            | (50)   |
| SGD                            | 2.950.500        | 30.04.2024       | USD     | 2.207.400              | HSBC Bank PLC                            | (18.344)   |
| SGD                            | 2.832            | 30.04.2024       | USD     | 2.107                  | HSBC Bank PLC                            | (6)  |
| SGD                            | 27.918           | 30.04.2024       | USD     | 20.771                 | HSBC Bank PLC                            | (58)   |
| SGD                            | 3.246            | 30.04.2024       | USD     | 2.410                  | HSBC Bank PLC                            | (2)  |
| USD                            | 17.381           | 30.04.2024       | SGD     | 23.455                 | HSBC Bank PLC                            | (21)   |
| SGD                            | 236.254          | 30.04.2024       | USD     | 176.752                | HSBC Bank PLC                            | (1.469)  |
| AUD                            | 438.484          | 30.04.2024       | USD     | 290.100                | HSBC Bank PLC                            | (3.812)  |
| USD                            | 2.201            | 30.04.2024       | AUD     | 3.390                  | HSBC Bank PLC                            | (12)   |
| SGD                            | 57.425           | 30.04.2024       | USD     | 42.962                 | HSBC Bank PLC                            | (357)  |
| USD                            | 1                | 30.04.2024       | SGD     | 1                      | HSBC Bank PLC                            | -  |
| EUR                            | 1.316.794        | 30.04.2024       | USD     | 1.439.221              | HSBC Bank PLC                            | (15.430)   |
| KRW                            | 890.000.000      | 28/06/2024       | USD     | 672.794                | UBS                                      | (10.012)   |
| CNY                            | 8.100.000        | 28/06/2024       | USD     | 1.132.788              | HSBC Bank PLC                            | (554)  |
| JPY                            | 140.000.000      | 30.04.2024       | USD     | 939.248                | UBS                                      | (10.114)   |
| IDR                            | 4.300.000.000    | 28/06/2024       | USD     | 273.408                | State Street Bank and Trust Co, Hongkong | (3.206)  |
| JPY                            | 132.000.000      | 28/06/2024       | USD     | 898.032                | UBS                                      | (14.124)   |
| JPY                            | 119.000.000      | 28/06/2024       | USD     | 814.088                | Westpac Banking Sydney                   | (17.232)   |

# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

| Teilfonds                      | Im Austausch für | Erfüllungstermin | Währung | Kontrakt zur Lieferung | Kontrahent                               | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|--------------------------------|------------------|------------------|---------|------------------------|--|--|
| <b>Asia Bond (Fortsetzung)</b> |                  |                  |         |                        |  |  |
| IDR                            | 14.000.000.000   | 28/06/2024       | USD     | 891.144                | State Street Bank and Trust Co, Hongkong | (11.418)   |
| IDR                            | 14.000.000.000   | 28/06/2024       | USD     | 895.825                | State Street Bank and Trust Co, Hongkong | (16.100)   |
| EUR                            | 1.000.000        | 28/06/2024       | USD     | 1.099.174              | BNP Paribas                              | (15.289)   |
| JPY                            | 140.000.000      | 28/06/2024       | USD     | 965.168                | HSBC Bank PLC                            | (27.690)   |
| INR                            | 80.100.000       | 28/06/2024       | USD     | 963.884                | BNP Paribas                              | (5.879)  |
| EUR                            | 910.000          | 28/06/2024       | USD     | 993.921                | Crédit Agricole                          | (7.585)  |
| JPY                            | 140.000.000      | 28/06/2024       | USD     | 957.666                | HSBC Bank PLC                            | (20.188)   |
| JPY                            | 140.000.000      | 28/06/2024       | USD     | 953.189                | Crédit Agricole                          | (15.711)   |
| KRW                            | 1.510.000.000    | 28/06/2024       | USD     | 1.139.270              | Merrill Lynch International Bank         | (14.776)   |
| JPY                            | 430.000.000      | 28/06/2024       | USD     | 2.903.526              | BNP Paribas                              | (24.130)   |
| JPY                            | 729.000.000      | 28/06/2024       | USD     | 4.922.737              | HSBC Bank PLC                            | (41.157)   |
| USD                            | 188.532          | 28/06/2024       | CNY     | 1.350.000              | Crédit Agricole                          | (173)  |
| KRW                            | 1.300.000.000    | 28/06/2024       | USD     | 975.851                | HSBC Bank PLC                            | (7.744)  |
| JPY                            | 145.000.000      | 28/06/2024       | USD     | 971.474                | State Street Bank and Trust Co, Hongkong | (515)  |
| KRW                            | 1.300.000.000    | 28/06/2024       | USD     | 984.632                | Crédit Agricole                          | (16.525)   |
| PHP                            | 106.000.000      | 28/06/2024       | USD     | 1.894.039              | BNP Paribas                              | (9.907)  |
| THB                            | 34.000.000       | 28/06/2024       | USD     | 938.603                | BNP Paribas                              | (14)   |
| KRW                            | 1.300.000.000    | 28/06/2024       | USD     | 975.976                | State Street Bank and Trust Co, Hongkong | (7.868)  |
| EUR                            | 1.860.000        | 28/06/2024       | USD     | 2.022.926              | HSBC Bank PLC                            | (6.898)  |
| INR                            | 81.000.000       | 28/06/2024       | USD     | 969.072                | UBS                                      | (304)  |
| EUR                            | 895.000          | 28/06/2024       | USD     | 972.035                | BNP Paribas                              | (1.957)  |
| IDR                            | 68.000.000.000   | 28/06/2024       | USD     | 4.292.929              | HSBC Bank PLC                            | (19.978)   |
| THB                            | 34.000.000       | 28/06/2024       | USD     | 941.959                | Merrill Lynch International Bank         | (3.370)  |
| KRW                            | 2.610.000.000    | 28/06/2024       | USD     | 1.947.892              | Merrill Lynch International Bank         | (4.230)  |
| <b>USD</b>                     |                  |                  |         |                        |  | <b>(3.002.547)</b>   |
| <b>Asia ESG Bond</b>           |                  |                  |         |                        |  |  |
| EUR                            | 1.031            | 30.04.2024       | USD     | 1.127                  | HSBC Bank PLC                            | (11)   |
| EUR                            | 766              | 30.04.2024       | USD     | 837                    | HSBC Bank PLC                            | (9)  |
| EUR                            | 756              | 30.04.2024       | USD     | 826                    | HSBC Bank PLC                            | (9)  |
| EUR                            | 771              | 30.04.2024       | USD     | 842                    | HSBC Bank PLC                            | (9)  |
| GBP                            | 1.157            | 30.04.2024       | USD     | 1.478                  | HSBC Bank PLC                            | (16)   |
| GBP                            | 500              | 30.04.2024       | USD     | 632                    | HSBC Bank PLC                            | (1)  |
| GBP                            | 56.138           | 30.04.2024       | USD     | 71.721                 | HSBC Bank PLC                            | (793)  |
| GBP                            | 663              | 30.04.2024       | USD     | 847                    | HSBC Bank PLC                            | (9)  |
| GBP                            | 667              | 30.04.2024       | USD     | 852                    | HSBC Bank PLC                            | (9)  |
| CHF                            | 768              | 30.04.2024       | USD     | 862                    | HSBC Bank PLC                            | (7)  |
| CHF                            | 784              | 30.04.2024       | USD     | 879                    | HSBC Bank PLC                            | (7)  |
| CHF                            | 779              | 30.04.2024       | USD     | 874                    | HSBC Bank PLC                            | (7)  |
| SGD                            | 1.191            | 30.04.2024       | USD     | 891                    | HSBC Bank PLC                            | (7)  |
| SGD                            | 51.112           | 30.04.2024       | USD     | 38.239                 | HSBC Bank PLC                            | (317)  |
| CNH                            | 319.860          | 30.04.2024       | USD     | 44.477                 | HSBC Bank PLC                            | (380)  |
| CNH                            | 5.606            | 30.04.2024       | USD     | 780                    | HSBC Bank PLC                            | (7)  |
| CNH                            | 5.680            | 30.04.2024       | USD     | 790                    | HSBC Bank PLC                            | (7)  |
| CNH                            | 5.717            | 30.04.2024       | USD     | 795                    | HSBC Bank PLC                            | (7)  |
| HKD                            | 7.064            | 30.04.2024       | USD     | 904                    | HSBC Bank PLC                            | (1)  |
| HKD                            | 6.953            | 30.04.2024       | USD     | 890                    | HSBC Bank PLC                            | (1)  |
| HKD                            | 7.103            | 30.04.2024       | USD     | 909                    | HSBC Bank PLC                            | (1)  |
| AUD                            | 1.215            | 30.04.2024       | USD     | 804                    | HSBC Bank PLC                            | (11)   |
| SGD                            | 1.210            | 30.04.2024       | USD     | 905                    | HSBC Bank PLC                            | (8)  |

# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

| Teilfonds                          | Im Austausch für | Erfüllungstermin | Währung | Kontrakt zur Lieferung | Kontrahent                               | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|------------------------------------|------------------|------------------|---------|------------------------|--|--|
| <b>Asia ESG Bond (Fortsetzung)</b> |                  |                  |         |                        |  |  |
| SGD                                | 1.242            | 30.04.2024       | USD     | 929                    | HSBC Bank PLC                            | (8)  |
| HKD                                | 6.954            | 30.04.2024       | USD     | 890                    | HSBC Bank PLC                            | (1)  |
| <b>USD</b>                         |                  |                  |         |                        |  | <b>(1.643)</b>   |
| <b>Asia High Yield Bond</b>        |                  |                  |         |                        |  |  |
| USD                                | 6.728            | 30.04.2024       | EUR     | 6.211                  | HSBC Bank PLC                            | 12   |
| USD                                | 14.351           | 30.04.2024       | GBP     | 11.328                 | HSBC Bank PLC                            | 40   |
| GBP                                | 2.813            | 30.04.2024       | USD     | 3.553                  | HSBC Bank PLC                            | 1  |
| GBP                                | 4.237            | 30.04.2024       | USD     | 5.352                  | HSBC Bank PLC                            | 2  |
| JPY                                | 39.119.488       | 30.04.2024       | USD     | 259.348                | HSBC Bank PLC                            | 275  |
| JPY                                | 456.780.530      | 30.04.2024       | USD     | 3.028.288              | HSBC Bank PLC                            | 3.216  |
| USD                                | 18.138           | 30.04.2024       | SGD     | 24.335                 | HSBC Bank PLC                            | 83   |
| USD                                | 2.179            | 30.04.2024       | SGD     | 2.929                  | HSBC Bank PLC                            | 6  |
| USD                                | 72.853           | 30.04.2024       | SGD     | 97.915                 | HSBC Bank PLC                            | 208  |
| USD                                | 1.480            | 30.04.2024       | SGD     | 1.992                  | HSBC Bank PLC                            | 1  |
| AUD                                | 8.691            | 30.04.2024       | USD     | 5.672                  | HSBC Bank PLC                            | 2  |
| USD                                | 16.706           | 30.04.2024       | AUD     | 25.536                 | HSBC Bank PLC                            | 34   |
| AUD                                | 198              | 30.04.2024       | USD     | 129                    | HSBC Bank PLC                            | -  |
| USD                                | 1.367.601        | 28/06/2024       | EUR     | 1.250.000              | BNP Paribas                              | 12.744   |
| USD                                | 1.902.429        | 28/06/2024       | EUR     | 1.730.000              | Crédit Agricole                          | 27.307   |
| USD                                | 5.177.470        | 28/06/2024       | KRW     | 6.780.000.000          | HSBC Bank PLC                            | 128.417  |
| USD                                | 1.703.215        | 28/06/2024       | THB     | 60.000.000             | UBS                                      | 46.881   |
| USD                                | 10.369.356       | 28/06/2024       | JPY     | 1.500.000.000          | State Street Bank and Trust Co, Hongkong | 324.952  |
| USD                                | 1.726.344        | 28/06/2024       | KRW     | 2.260.000.000          | State Street Bank and Trust Co, Hongkong | 43.326   |
| USD                                | 1.721.289        | 28/06/2024       | THB     | 61.000.000             | BNP Paribas                              | 37.350   |
| USD                                | 1.719.613        | 28/06/2024       | THB     | 61.000.000             | UBS                                      | 35.674   |
| USD                                | 1.867.618        | 28/06/2024       | EUR     | 1.700.000              | Crédit Agricole                          | 25.012   |
| USD                                | 1.718.710        | 28/06/2024       | PHP     | 95.500.000             | BNP Paribas                              | 21.213   |
| USD                                | 1.734.625        | 28/06/2024       | THB     | 62.000.000             | Merrill Lynch International Bank         | 23.080   |
| USD                                | 1.725.033        | 28/06/2024       | PHP     | 96.000.000             | HSBC Bank PLC                            | 18.649   |
| USD                                | 1.514.912        | 28/06/2024       | EUR     | 1.380.000              | BNP Paribas                              | 19.149   |
| USD                                | 10.148.258       | 28/06/2024       | EUR     | 9.245.000              | State Street Bank and Trust Co, Hongkong | 127.734  |
| USD                                | 1.749.686        | 28/06/2024       | EUR     | 1.600.000              | BNP Paribas                              | 15.468   |
| USD                                | 1.960.192        | 28/06/2024       | EUR     | 1.800.000              | BNP Paribas                              | 9.197  |
| <b>USD</b>                         |                  |                  |         |                        |  | <b>920.033</b>   |
| EUR                                | 1.554.708        | 30.04.2024       | USD     | 1.699.256              | HSBC Bank PLC                            | (18.218)   |
| EUR                                | 83.937           | 30.04.2024       | USD     | 91.741                 | HSBC Bank PLC                            | (984)  |
| EUR                                | 10.154.852       | 30.04.2024       | USD     | 11.098.989             | HSBC Bank PLC                            | (118.991)  |
| EUR                                | 4.470            | 30.04.2024       | USD     | 4.862                  | HSBC Bank PLC                            | (29)   |
| EUR                                | 2.265            | 30.04.2024       | USD     | 2.458                  | HSBC Bank PLC                            | (9)  |
| EUR                                | 2.142            | 30.04.2024       | USD     | 2.322                  | HSBC Bank PLC                            | (7)  |
| EUR                                | 20.663           | 30.04.2024       | USD     | 22.382                 | HSBC Bank PLC                            | (40)   |
| USD                                | 298.912          | 30.04.2024       | EUR     | 277.118                | HSBC Bank PLC                            | (724)  |
| EUR                                | 200.035          | 30.04.2024       | USD     | 218.633                | HSBC Bank PLC                            | (2.344)  |

# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

| Teilfonds                                 | Im Austausch für | Erfüllungstermin | Währung | Kontrakt zur Lieferung | Kontrahent                               | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|---|------------------|------------------|---------|------------------------|--|--|
| <b>Asia High Yield Bond (Fortsetzung)</b> |                  |                  |         |                        |  |  |
| EUR                                       | 1.071.077        | 30.04.2024       | USD     | 1.170.659              | HSBC Bank PLC                            | (12.551)   |
| EUR                                       | 551.262          | 30.04.2024       | USD     | 602.515                | HSBC Bank PLC                            | (6.460)  |
| GBP                                       | 16.323.587       | 30.04.2024       | USD     | 20.854.688             | HSBC Bank PLC                            | (230.823)  |
| USD                                       | 6.349            | 30.04.2024       | GBP     | 5.037                  | HSBC Bank PLC                            | (16)   |
| GBP                                       | 9.769            | 30.04.2024       | USD     | 12.355                 | HSBC Bank PLC                            | (12)   |
| USD                                       | 554.248          | 30.04.2024       | GBP     | 440.052                | HSBC Bank PLC                            | (1.731)  |
| USD                                       | 87.719           | 30.04.2024       | JPY     | 13.228.308             | HSBC Bank PLC                            | (73)   |
| CHF                                       | 118.689          | 30.04.2024       | USD     | 133.205                | HSBC Bank PLC                            | (1.036)  |
| CHF                                       | 27.249           | 30.04.2024       | USD     | 30.582                 | HSBC Bank PLC                            | (238)  |
| CHF                                       | 181.592          | 30.04.2024       | USD     | 203.800                | HSBC Bank PLC                            | (1.585)  |
| USD                                       | 5.902            | 30.04.2024       | CHF     | 5.333                  | HSBC Bank PLC                            | (37)   |
| CHF                                       | 643.028          | 30.04.2024       | USD     | 721.669                | HSBC Bank PLC                            | (5.613)  |
| SGD                                       | 868.728          | 30.04.2024       | USD     | 649.934                | HSBC Bank PLC                            | (5.401)  |
| SGD                                       | 7.320            | 30.04.2024       | USD     | 5.446                  | HSBC Bank PLC                            | (15)   |
| SGD                                       | 1.308            | 30.04.2024       | USD     | 971                    | HSBC Bank PLC                            | (1)  |
| USD                                       | 17.880           | 30.04.2024       | SGD     | 24.129                 | HSBC Bank PLC                            | (22)   |
| SGD                                       | 49.694.950       | 30.04.2024       | USD     | 37.179.008             | HSBC Bank PLC                            | (308.961)  |
| SGD                                       | 389.432          | 30.04.2024       | USD     | 289.031                | HSBC Bank PLC                            | (101)  |
| SGD                                       | 98.406           | 30.04.2024       | USD     | 73.215                 | HSBC Bank PLC                            | (205)  |
| SGD                                       | 3.327            | 30.04.2024       | USD     | 2.471                  | HSBC Bank PLC                            | (2)  |
| SGD                                       | 49.954.213       | 30.04.2024       | USD     | 37.372.975             | HSBC Bank PLC                            | (310.573)  |
| SGD                                       | 10.216           | 30.04.2024       | USD     | 7.614                  | HSBC Bank PLC                            | (35)   |
| SGD                                       | 49.897           | 30.04.2024       | USD     | 37.033                 | HSBC Bank PLC                            | (13)   |
| SGD                                       | 80.178           | 30.04.2024       | USD     | 59.653                 | HSBC Bank PLC                            | (167)  |
| SGD                                       | 2.236.650        | 30.04.2024       | USD     | 1.673.338              | HSBC Bank PLC                            | (13.906)   |
| SGD                                       | 992              | 30.04.2024       | USD     | 736                    | HSBC Bank PLC                            | -  |
| AUD                                       | 9.809.897        | 30.04.2024       | USD     | 6.490.198              | HSBC Bank PLC                            | (85.276)   |
| AUD                                       | 2.000            | 30.04.2024       | USD     | 1.315                  | HSBC Bank PLC                            | (9)  |
| AUD                                       | 15.866           | 30.04.2024       | USD     | 10.382                 | HSBC Bank PLC                            | (23)   |
| USD                                       | 131              | 30.04.2024       | AUD     | 201                    | HSBC Bank PLC                            | -  |
| AUD                                       | 122.965          | 30.04.2024       | USD     | 81.353                 | HSBC Bank PLC                            | (1.069)  |
| USD                                       | 2.193            | 30.04.2024       | AUD     | 3.378                  | HSBC Bank PLC                            | (12)   |
| AUD                                       | 4.173.752        | 30.04.2024       | USD     | 2.761.342              | HSBC Bank PLC                            | (36.282)   |
| EUR                                       | 4.146.990        | 30.04.2024       | USD     | 4.532.552              | HSBC Bank PLC                            | (48.593)   |
| SGD                                       | 1.906.279        | 30.04.2024       | USD     | 1.426.172              | HSBC Bank PLC                            | (11.852)   |
| KRW                                       | 2.400.000.000    | 28/06/2024       | USD     | 1.814.275              | UBS                                      | (27.000)   |
| IDR                                       | 31.000.000.000   | 28/06/2024       | USD     | 1.971.077              | State Street Bank and Trust Co, Hongkong | (23.114)   |
| JPY                                       | 250.000.000      | 28/06/2024       | USD     | 1.700.818              | UBS                                      | (26.750)   |
| JPY                                       | 250.000.000      | 28/06/2024       | USD     | 1.699.929              | HSBC Bank PLC                            | (25.861)   |
| JPY                                       | 240.000.000      | 28/06/2024       | USD     | 1.641.858              | Westpac Banking Sydney                   | (34.752)   |
| IDR                                       | 28.000.000.000   | 28/06/2024       | USD     | 1.782.287              | State Street Bank and Trust Co, Hongkong | (22.837)   |
| IDR                                       | 25.000.000.000   | 28/06/2024       | USD     | 1.599.687              | State Street Bank and Trust Co, Hongkong | (28.749)   |
| USD                                       | 1.612.027        | 28/06/2024       | CNY     | 11.500.000             | Westpac Banking Sydney                   | (2.903)  |
| EUR                                       | 1.500.000        | 28/06/2024       | USD     | 1.648.761              | BNP Paribas                              | (22.932)   |
| JPY                                       | 251.000.000      | 28/06/2024       | USD     | 1.730.409              | HSBC Bank PLC                            | (49.645)   |
| INR                                       | 144.000.000      | 28/06/2024       | USD     | 1.732.825              | BNP Paribas                              | (10.569)   |
| EUR                                       | 1.580.000        | 28/06/2024       | USD     | 1.725.709              | Crédit Agricole                          | (13.168)   |
| JPY                                       | 252.000.000      | 28/06/2024       | USD     | 1.723.799              | HSBC Bank PLC                            | (36.339)   |
| JPY                                       | 253.000.000      | 28/06/2024       | USD     | 1.722.549              | Crédit Agricole                          | (28.393)   |

# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

| Teilfonds  | Im Austausch für | Erfüllungstermin | Währung | Kontrakt zur Lieferung | Kontrahent                               | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|--|------------------|------------------|---------|------------------------|--|--|
| <b>Asia High Yield Bond (Fortsetzung)</b>                                |                  |                  |         |                        |  |  |
| KRW  | 2.480.000.000    | 28/06/2024       | USD     | 1.871.119              | Merrill Lynch International Bank         | (24.268)   |
| JPY  | 762.000.000      | 28/06/2024       | USD     | 5.145.318              | BNP Paribas                              | (42.760)   |
| JPY  | 1.260.000.000    | 28/06/2024       | USD     | 8.508.435              | HSBC Bank PLC                            | (71.135)   |
| KRW  | 2.300.000.000    | 28/06/2024       | USD     | 1.726.506              | HSBC Bank PLC                            | (13.701)   |
| JPY  | 257.000.000      | 28/06/2024       | USD     | 1.721.854              | State Street Bank and Trust Co, Hongkong | (913)  |
| KRW  | 2.300.000.000    | 28/06/2024       | USD     | 1.742.042              | Crédit Agricole                          | (29.236)   |
| PHP  | 191.500.000      | 28/06/2024       | USD     | 3.421.778              | BNP Paribas                              | (17.897)   |
| THB  | 61.000.000       | 28/06/2024       | USD     | 1.684.552              | UBS                                      | (613)  |
| THB  | 60.000.000       | 28/06/2024       | USD     | 1.656.937              | UBS                                      | (603)  |
| THB  | 61.000.000       | 28/06/2024       | USD     | 1.683.964              | BNP Paribas                              | (24)   |
| KRW  | 2.300.000.000    | 28/06/2024       | USD     | 1.726.727              | State Street Bank and Trust Co, Hongkong | (13.921)   |
| EUR  | 3.040.000        | 28/06/2024       | USD     | 3.306.288              | HSBC Bank PLC                            | (11.275)   |
| INR  | 145.000.000      | 28/06/2024       | USD     | 1.734.759              | UBS                                      | (544)  |
| EUR  | 1.600.000        | 28/06/2024       | USD     | 1.737.716              | BNP Paribas                              | (3.499)  |
| IDR  | 101.500.000.000  | 28/06/2024       | USD     | 6.407.828              | HSBC Bank PLC                            | (29.821)   |
| THB  | 62.000.000       | 28/06/2024       | USD     | 1.717.689              | Merrill Lynch International Bank         | (6.145)  |
| KRW  | 4.000.000.000    | 28/06/2024       | USD     | 2.985.275              | Merrill Lynch International Bank         | (6.483)  |
|  |                  |                  |         |                        | <b>USD</b>                               | <b>(1.849.889)</b>   |
| <b>Asian Currencies Bond</b>   |                  |                  |         |                        |  |  |
| USD  | 532.774          | 31/05/2024       | EUR     | 486.000                | Australia and New Zealand Banking        | 5.585  |
| USD  | 270.000          | 31/05/2024       | KRW     | 356.739.093            | UBS                                      | 5.076  |
| USD  | 59.275           | 31/05/2024       | MYR     | 280.000                | BNP Paribas                              | 101  |
| USD  | 45.000           | 31/05/2024       | IDR     | 712.062.450            | Westpac Banking Sydney                   | 270  |
|  |                  |                  |         |                        | USD                                      | 11.032   |
| JPY  | 74.909.000       | 31/05/2024       | USD     | 503.825                | Crédit Agricole                          | (4.195)  |
| SGD  | 410.000          | 31/05/2024       | USD     | 307.474                | BNP Paribas                              | (2.587)  |
| PHP  | 25.768.454       | 31/05/2024       | USD     | 458.000                | Westpac Banking Sydney                   | (313)  |
| USD  | 33.296           | 31/05/2024       | JPY     | 4.995.000              | Crédit Agricole                          | (20)   |
| KRW  | 146.786.750      | 31/05/2024       | USD     | 110.000                | State Street Bank and Trust Co, Hongkong | (992)  |
| EUR  | 56.000           | 31/05/2024       | USD     | 60.812                 | Australia and New Zealand Banking        | (66)   |
| THB  | 4.011.000        | 31/05/2024       | USD     | 110.730                | UBS                                      | (6)  |
|  |                  |                  |         |                        | <b>USD</b>                               | <b>(8.179)</b>   |
| <b>Corporate Euro Bond Fixed Term 2027 (aufgelegt zum 30. Juni 2023)</b> |                  |                  |         |                        |  |  |
| USD  | 2.660.742        | 30.04.2024       | EUR     | 2.434.878              | HSBC Bank PLC                            | 26.007   |
| USD  | 1.077.877        | 30.04.2024       | EUR     | 986.378                | HSBC Bank PLC                            | 10.536   |
|  |                  |                  |         |                        | <b>EUR</b>                               | <b>36.543</b>  |
| <b>Euro Bond Total Return</b>  |                  |                  |         |                        |  |  |
| EUR  | 2.522.000        | 05/04/2024       | NZD     | 4.509.540              | Morgan Stanley, London                   | 24.619   |
|  |                  |                  |         |                        | <b>EUR</b>                               | <b>24.619</b>  |
| JPY  | 327.259.396      | 05/04/2024       | EUR     | 2.050.000              | Royal Bank of Canada, London             | (46.936)   |
| EUR  | 1.960.000        | 05/04/2024       | USD     | 2.130.540              | Bank of America                          | (12.484)   |
| AUD  | 1.517.570        | 05/04/2024       | EUR     | 920.000                | Crédit Agricole                          | (3.296)  |
|  |                  |                  |         |                        | <b>USD</b>                               | <b>(62.716)</b>  |

# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

| Teilfonds                             | Im Austausch für | Erfüllungstermin | Währung | Kontrakt zur Lieferung | Kontrahent                      | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|---------------------------------------|------------------|------------------|---------|------------------------|---------------------------------|--|
| <b>Euro High Yield Bond</b>           |                  |                  |         |                        |                                 |  |
| EUR                                   | 3.548.490        | 12/04/2024       | USD     | 3.830.000              | Morgan Stanley, London          | 3.616  |
| USD                                   | 1.277.273        | 30.04.2024       | EUR     | 1.168.849              | HSBC Bank PLC                   | 12.485   |
| USD                                   | 8.290.401        | 30.04.2024       | EUR     | 7.586.648              | HSBC Bank PLC                   | 81.035   |
| USD                                   | 4.030            | 30.04.2024       | EUR     | 3.705                  | HSBC Bank PLC                   | 22   |
| USD                                   | 131              | 30.04.2024       | EUR     | 120                    | HSBC Bank PLC                   | -  |
| USD                                   | 41               | 30.04.2024       | EUR     | 38                     | HSBC Bank PLC                   | -  |
| CHF                                   | 34.714           | 30.04.2024       | EUR     | 35.653                 | HSBC Bank PLC                   | 101  |
|                                       |                  |                  |         |                        | <b>EUR</b>                      | <b>97.259</b>  |
| EUR                                   | 11.091           | 30.04.2024       | USD     | 12.025                 | HSBC Bank PLC                   | (31)   |
|                                       |                  |                  |         |                        | <b>EUR</b>                      | <b>(31)</b>  |
| <b>ESG Short Duration Credit Bond</b> |                  |                  |         |                        |                                 |  |
| USD                                   | 810.620          | 03/04/2024       | EUR     | 747.000                | Standard Chartered Bank, London | 3.796  |
|                                       |                  |                  |         |                        | <b>USD</b>                      | <b>3.796</b>   |
| EUR                                   | 257.541          | 30.04.2024       | USD     | 281.485                | HSBC Bank PLC                   | (3.018)  |
| EUR                                   | 104.228          | 30.04.2024       | USD     | 113.918                | HSBC Bank PLC                   | (1.221)  |
| USD                                   | 1.362            | 30.04.2024       | EUR     | 1.263                  | HSBC Bank PLC                   | (3)  |
| EUR                                   | 103.690          | 30.04.2024       | USD     | 113.331                | HSBC Bank PLC                   | (1.215)  |
| GBP                                   | 377.940          | 30.04.2024       | USD     | 482.849                | HSBC Bank PLC                   | (5.344)  |
| GBP                                   | 5.000            | 30.04.2024       | USD     | 6.335                  | HSBC Bank PLC                   | (17)   |
| GBP                                   | 105.907          | 30.04.2024       | USD     | 135.304                | HSBC Bank PLC                   | (1.498)  |
| USD                                   | 1.576            | 30.04.2024       | GBP     | 1.251                  | HSBC Bank PLC                   | (5)  |
| GBP                                   | 105.361          | 30.04.2024       | USD     | 134.607                | HSBC Bank PLC                   | (1.490)  |
| GBP                                   | 105.350          | 30.04.2024       | USD     | 134.593                | HSBC Bank PLC                   | (1.490)  |
| CHF                                   | 101.816          | 30.04.2024       | USD     | 114.268                | HSBC Bank PLC                   | (889)  |
| USD                                   | 1.533            | 30.04.2024       | CHF     | 1.385                  | HSBC Bank PLC                   | (10)   |
| CHF                                   | 101.221          | 30.04.2024       | USD     | 113.600                | HSBC Bank PLC                   | (884)  |
| SGD                                   | 1.473.742        | 30.04.2024       | USD     | 1.102.572              | HSBC Bank PLC                   | (9.161)  |
| AUD                                   | 370.177          | 30.04.2024       | USD     | 244.908                | HSBC Bank PLC                   | (3.218)  |
| EUR                                   | 103.649          | 30.04.2024       | USD     | 113.286                | HSBC Bank PLC                   | (1.215)  |
| USD                                   | 806.845          | 03/05/2024       | EUR     | 747.000                | BNP Paribas                     | (947)  |
|                                       |                  |                  |         |                        | <b>USD</b>                      | <b>(31.625)</b>  |

# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

| Teilfonds                    | Im Austausch für | Erfüllungstermin | Währung | Kontrakt zur Lieferung | Kontrahent                          | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|------------------------------|------------------|------------------|---------|------------------------|-------------------------------------|--|
| <b>GEM Debt Total Return</b> |                  |                  |         |                        |                                     |  |
| USD                          | 3.398.976        | 05/04/2024       | MYR     | 15.880.018             | Morgan Stanley, London              | 47.005   |
| MYR                          | 3.824.384        | 05/04/2024       | USD     | 800.000                | Morgan Stanley, London              | 7.255  |
| USD                          | 420.000          | 24/04/2024       | THB     | 15.057.588             | Standard Chartered Bank, London     | 6.586  |
| USD                          | 420.000          | 24/04/2024       | THB     | 15.097.236             | Standard Chartered Bank, London     | 5.498  |
| USD                          | 410.000          | 24/04/2024       | THB     | 14.774.842             | Standard Chartered Bank, London     | 4.349  |
| USD                          | 706.538          | 24/04/2024       | THB     | 25.516.609             | Standard Chartered Bank, London     | 5.967  |
| PLN                          | 6.248.000        | 25/04/2024       | USD     | 1.552.004              | Deutsche Bank, London               | 14.479   |
| USD                          | 600.000          | 25/04/2024       | PLN     | 2.367.355              | Barclays Bank, London               | 6.463  |
| USD                          | 600.000          | 25/04/2024       | PLN     | 2.384.031              | J.P. Morgan Chase Bank, New York    | 2.282  |
| USD                          | 600.000          | 25/04/2024       | PLN     | 2.387.218              | Merrill Lynch International Bank    | 1.483  |
| USD                          | 1.622.843        | 25/04/2024       | PLN     | 6.455.408              | Barclays Bank, London               | 4.360  |
| USD                          | 180.000          | 26/04/2024       | HUF     | 65.125.501             | J.P. Morgan Chase Bank, New York    | 1.787  |
| USD                          | 170.000          | 26/04/2024       | HUF     | 61.888.043             | BNP Paribas                         | 646  |
| USD                          | 170.000          | 26/04/2024       | HUF     | 61.926.660             | Goldman Sachs International, London | 541  |
| USD                          | 62.204           | 26/04/2024       | HUF     | 22.713.498             | Merrill Lynch International Bank    | 49   |
| USD                          | 4.403            | 30.04.2024       | EUR     | 4.057                  | HSBC Bank PLC                       | 17   |
| USD                          | 66               | 30.04.2024       | EUR     | 61                     | HSBC Bank PLC                       | -  |
| USD                          | 7.681            | 30.04.2024       | EUR     | 7.092                  | HSBC Bank PLC                       | 13   |
| USD                          | 1.147.969        | 03/05/2024       | BRL     | 5.716.991              | Goldman Sachs International, London | 9.346  |
| USD                          | 800.000          | 03/05/2024       | BRL     | 3.967.552              | Barclays Bank, London               | 9.803  |
| BRL                          | 4.029.992        | 03/05/2024       | USD     | 800.000                | Deutsche Bank, London               | 2.633  |
| USD                          | 700.000          | 03/05/2024       | BRL     | 3.510.360              | Morgan Stanley, London              | 859  |
| USD                          | 500.000          | 03/05/2024       | BRL     | 2.506.225              | J.P. Morgan Chase Bank, New York    | 848  |
| USD                          | 400.000          | 10/05/2024       | CLP     | 366.168.000            | Barclays Bank, London               | 27.113   |
| USD                          | 800.000          | 10/05/2024       | CLP     | 776.688.000            | Citibank, New York                  | 9.059  |
| USD                          | 150.000          | 10/05/2024       | CLP     | 141.756.000            | Morgan Stanley, London              | 5.643  |
| USD                          | 140.000          | 10/05/2024       | CLP     | 132.891.056            | Goldman Sachs International, London | 4.670  |
| USD                          | 160.000          | 10/05/2024       | CLP     | 154.977.600            | Morgan Stanley, London              | 2.178  |
| USD                          | 750.000          | 10/05/2024       | CLP     | 732.298.110            | Goldman Sachs International, London | 4.264  |
| CLP                          | 1.012.911.247    | 10/05/2024       | USD     | 1.027.427              | Goldman Sachs International, London | 4.071  |
| USD                          | 100.000          | 16/05/2024       | RON     | 457.516                | Merrill Lynch International Bank    | 641  |
| USD                          | 100.000          | 16/05/2024       | RON     | 458.574                | Merrill Lynch International Bank    | 412  |
| USD                          | 110.000          | 22/05/2024       | PEN     | 406.186                | Merrill Lynch International Bank    | 936  |
| USD                          | 100.000          | 22/05/2024       | PEN     | 369.713                | Morgan Stanley, London              | 729  |
| USD                          | 110.000          | 22/05/2024       | PEN     | 407.143                | Merrill Lynch International Bank    | 679  |
| USD                          | 400.000          | 23/05/2024       | CZK     | 9.234.190              | Goldman Sachs International, London | 5.637  |
| USD                          | 400.000          | 23/05/2024       | CZK     | 9.276.544              | Merrill Lynch International Bank    | 3.829  |
| USD                          | 400.000          | 23/05/2024       | CZK     | 9.314.220              | Barclays Bank, London               | 2.220  |
| USD                          | 50.000           | 23/05/2024       | CZK     | 1.169.912              | UBS, London                         | 37   |
| USD                          | 1.608.440        | 24/05/2024       | TWD     | 49.995.150             | Crédit Agricole                     | 41.845   |
| EGP                          | 10.573.500       | 28/05/2024       | USD     | 210.000                | J.P. Morgan Chase Bank, New York    | 10.107   |
| USD                          | 234.186          | 28/05/2024       | EGP     | 10.573.500             | J.P. Morgan Chase Bank, New York    | 14.079   |
| COP                          | 4.647.432.830    | 07/06/2024       | USD     | 1.141.477              | Morgan Stanley, London              | 47.915   |
| USD                          | 50.000           | 07/06/2024       | COP     | 194.127.000            | Merrill Lynch International Bank    | 318  |
| MXN                          | 20.869.000       | 11/06/2024       | USD     | 1.224.644              | Barclays Bank, London               | 17.213   |
| MXN                          | 61.800.000       | 11/06/2024       | USD     | 3.623.489              | Morgan Stanley, London              | 54.060   |
| USD                          | 80.000           | 11/06/2024       | MXN     | 1.337.024              | BNP Paribas                         | 437  |
| USD                          | 1.807.532        | 12/06/2024       | IDR     | 28.208.157.972         | BNP Paribas                         | 34.248   |
| USD                          | 470.000          | 12/06/2024       | IDR     | 7.361.845.000          | Morgan Stanley, London              | 7.203  |
| USD                          | 460.000          | 12/06/2024       | IDR     | 7.251.164.000          | Merrill Lynch International Bank    | 4.161  |

# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

| Teilfonds                                  | Im Austausch für | Erfüllungstermin | Währung | Kontrakt zur Lieferung | Kontrahent                          | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|--|------------------|------------------|---------|------------------------|-------------------------------------|--|
| <b>GEM Debt Total Return (Fortsetzung)</b> |                  |                  |         |                        |                                     |  |
| USD  | 470.000          | 12/06/2024       | IDR     | 7.415.378.000          | Morgan Stanley, London              | 3.838  |
| USD  | 1.605.128        | 14/06/2024       | CNY     | 11.393.681             | BNP Paribas                         | 12.342   |
| USD  | 447.248          | 18/06/2024       | EUR     | 411.941                | Merrill Lynch International Bank    | 955  |
| USD  | 151.237          | 18/06/2024       | EUR     | 138.430                | Standard Chartered Bank, London     | 1.263  |
| USD  | 300.000          | 20/06/2024       | NGN     | 252.900.000            | Standard Chartered Bank, London     | 109.507  |
| USD  | 300.000          | 20/06/2024       | NGN     | 253.500.000            | Standard Chartered Bank, London     | 109.054  |
| USD  | 293.886          | 20/06/2024       | NGN     | 264.600.000            | BNP Paribas                         | 94.579   |
| USD  | 485.114          | 20/06/2024       | GBP     | 383.716                | Barclays Bank, London               | 178  |
| USD  | 800.000          | 25/06/2024       | MYR     | 3.728.400              | Barclays Bank, London               | 15.927   |
| USD  | 440.000          | 25/06/2024       | MYR     | 2.059.728              | Barclays Bank, London               | 6.844  |
| USD  | 430.000          | 25/06/2024       | MYR     | 2.019.108              | Barclays Bank, London               | 5.386  |
| USD  | 440.000          | 25/06/2024       | MYR     | 2.077.188              | Goldman Sachs International, London | 3.172  |
| USD  | 50.000           | 25/06/2024       | MYR     | 236.350                | Barclays Bank, London               | 296  |
| USD  | 2.100.000        | 09/07/2024       | ZAR     | 39.560.703             | Morgan Stanley, London              | 27.727   |
| USD  | 70.000           | 15/07/2024       | PLN     | 279.384                | Goldman Sachs International, London | 26   |
| THB  | 4.346.124        | 17/07/2024       | USD     | 120.000                | Standard Chartered Bank, London     | 175  |
| USD  | 270.743          | 02/08/2024       | BRL     | 1.365.794              | Barclays Bank, London               | 1.020  |
| USD  | 50.000           | 02/08/2024       | BRL     | 251.864                | Goldman Sachs International, London | 261  |
| EGP  | 11.250.000       | 11/03/2025       | USD     | 200.000                | J.P. Morgan Chase Bank, New York    | 11.521   |
| EGP  | 11.600.000       | 11/03/2025       | USD     | 200.000                | J.P. Morgan Chase Bank, New York    | 18.102   |
|  |                  |                  |         |                        | <b>USD</b>                          | <b>858.146</b>   |
| MYR  | 4.981.664        | 05/04/2024       | USD     | 1.070.842              | Barclays Bank, London               | (19.307)   |
| MYR  | 7.073.970        | 05/04/2024       | USD     | 1.500.000              | Morgan Stanley, London              | (6.819)  |
| THB  | 53.157.923       | 24/04/2024       | USD     | 1.555.918              | Standard Chartered Bank, London     | (96.440)   |
| THB  | 17.288.352       | 24/04/2024       | USD     | 480.000                | Standard Chartered Bank, London     | (5.340)  |
| PLN  | 4.597.161        | 25/04/2024       | USD     | 1.155.888              | Barclays Bank, London               | (3.300)  |
| PLN  | 2.748.851        | 25/04/2024       | USD     | 700.000                | Citibank, New York                  | (10.815)   |
| HUF  | 51.238.274       | 26/04/2024       | USD     | 146.713                | BNP Paribas                         | (6.501)  |
| HUF  | 235.429.188      | 26/04/2024       | USD     | 650.000                | Deutsche Bank, London               | (5.758)  |
| HUF  | 145.191.400      | 26/04/2024       | USD     | 400.000                | Citibank, New York                  | (2.690)  |
| USD  | 600.000          | 26/04/2024       | HUF     | 220.205.160            | Citibank, New York                  | (2.581)  |
| EUR  | 3.947            | 30.04.2024       | USD     | 4.314                  | HSBC Bank PLC                       | (46)   |
| EUR  | 10.478.686       | 30.04.2024       | USD     | 11.452.931             | HSBC Bank PLC                       | (122.786)  |
| EUR  | 3.046.650        | 30.04.2024       | USD     | 3.329.910              | HSBC Bank PLC                       | (35.700)   |
| EUR  | 2.560.432        | 30.04.2024       | USD     | 2.798.486              | HSBC Bank PLC                       | (30.002)   |
| EUR  | 48.024           | 30.04.2024       | USD     | 52.489                 | HSBC Bank PLC                       | (563)  |
| EUR  | 114.075          | 30.04.2024       | USD     | 124.681                | HSBC Bank PLC                       | (1.337)  |
| EUR  | 85.341           | 30.04.2024       | USD     | 93.276                 | HSBC Bank PLC                       | (1.000)  |
| CHF  | 228.380          | 30.04.2024       | USD     | 256.311                | HSBC Bank PLC                       | (1.994)  |
| BRL  | 8.281.703        | 03/05/2024       | USD     | 1.675.000              | Citibank, New York                  | (25.574)   |
| BRL  | 3.999.686        | 03/05/2024       | USD     | 800.000                | UBS, London                         | (3.403)  |
| USD  | 410.000          | 03/05/2024       | BRL     | 2.066.195              | Barclays Bank, London               | (1.514)  |
| BRL  | 3.992.256        | 03/05/2024       | USD     | 800.000                | BNP Paribas                         | (4.883)  |
| BRL  | 3.003.268        | 03/05/2024       | USD     | 600.000                | UBS, London                         | (1.854)  |



# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

| Teilfonds                                  | Im Austausch für | Erfüllungstermin | Währung | Kontrakt zur Lieferung | Kontrahent                               | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|--|------------------|------------------|---------|------------------------|--|--|
| <b>GEM Debt Total Return (Fortsetzung)</b> |                  |                  |         |                        |  |  |
| USD  | 690.000          | 03/05/2024       | BRL     | 3.476.441              | Barclays Bank, London                    | (2.385)  |
| USD  | 680.000          | 03/05/2024       | BRL     | 3.428.934              | J.P. Morgan Chase Bank, New York         | (2.923)  |
| BRL  | 1.365.794        | 03/05/2024       | USD     | 273.070                | Barclays Bank, London                    | (1.052)  |
| CLP  | 136.931.519      | 10/05/2024       | USD     | 150.156                | BNP Paribas                              | (10.712)   |
| CLP  | 738.256.000      | 10/05/2024       | USD     | 800.000                | Morgan Stanley, London                   | (48.197)   |
| CLP  | 416.680.000      | 10/05/2024       | USD     | 440.000                | Citibank, New York                       | (15.674)   |
| RON  | 2.240.728        | 16/05/2024       | USD     | 487.831                | BNP Paribas                              | (1.213)  |
| USD  | 180.589          | 22/05/2024       | PEN     | 694.980                | Crédit Agricole                          | (6.018)  |
| CZK  | 64.083.671       | 23/05/2024       | USD     | 2.761.513              | Morgan Stanley, London                   | (24.705)   |
| USD  | 400.000          | 23/05/2024       | CZK     | 9.384.800              | Merrill Lynch International Bank         | (795)  |
| TWD  | 8.514.207        | 24/05/2024       | USD     | 270.000                | Standard Chartered Bank, London          | (3.208)  |
| TWD  | 8.518.770        | 24/05/2024       | USD     | 270.000                | Crédit Agricole                          | (3.065)  |
| TWD  | 8.551.440        | 24/05/2024       | USD     | 270.000                | Deutsche Bank, London                    | (2.041)  |
| TWD  | 23.847.000       | 24/05/2024       | USD     | 750.000                | Deutsche Bank, London                    | (2.756)  |
| USD  | 200.000          | 07/06/2024       | COP     | 787.816.000            | Merrill Lynch International Bank         | (1.621)  |
| USD  | 200.000          | 07/06/2024       | COP     | 785.998.000            | Crédit Agricole                          | (1.156)  |
| USD  | 200.000          | 07/06/2024       | COP     | 789.837.900            | BNP Paribas                              | (2.139)  |
| USD  | 1.675.524        | 11/06/2024       | MXN     | 29.219.888             | Morgan Stanley, London                   | (63.271)   |
| USD  | 660.000          | 11/06/2024       | MXN     | 11.159.376             | BNP Paribas                              | (4.064)  |
| USD  | 5.467            | 11/06/2024       | MXN     | 93.000                 | BNP Paribas                              | (68)   |
| USD  | 730.000          | 11/06/2024       | MXN     | 12.433.100             | Citibank, New York                       | (9.860)  |
| USD  | 500.000          | 11/06/2024       | MXN     | 8.566.945              | Citibank, New York                       | (9.795)  |
| USD  | 740.000          | 11/06/2024       | MXN     | 12.619.449             | BNP Paribas                              | (10.949)   |
| MXN  | 1.800.000        | 11/06/2024       | USD     | 107.624                | Morgan Stanley, London                   | (511)  |
| IDR  | 27.466.425.000   | 12/06/2024       | USD     | 1.750.000              | BNP Paribas                              | (23.345)   |
| IDR  | 22.258.600.000   | 12/06/2024       | USD     | 1.400.000              | Citibank, New York                       | (731)  |
| USD  | 60.000           | 12/06/2024       | IDR     | 955.866.000            | Merrill Lynch International Bank         | (90)   |
| CNY  | 1.915.284        | 14/06/2024       | USD     | 270.000                | Citibank, New York                       | (2.252)  |
| CNY  | 1.914.849        | 14/06/2024       | USD     | 270.000                | Citibank, New York                       | (2.312)  |
| CNY  | 1.916.376        | 14/06/2024       | USD     | 270.000                | BNP Paribas                              | (2.099)  |
| NGN  | 255.000.000      | 20/06/2024       | USD     | 300.000                | Standard Chartered Bank, London          | (107.923)  |
| NGN  | 256.500.000      | 20/06/2024       | USD     | 300.000                | Goldman Sachs International, London      | (106.793)  |
| NGN  | 259.500.000      | 20/06/2024       | USD     | 300.000                | Merrill Lynch International Bank, London | (104.535)  |
| GBP  | 220.000          | 20/06/2024       | USD     | 280.204                | Standard Chartered Bank, London          | (2.171)  |
| GBP  | 239.500          | 20/06/2024       | USD     | 305.739                | Morgan Stanley, London                   | (3.062)  |
| MYR  | 15.880.018       | 25/06/2024       | USD     | 3.413.883              | Morgan Stanley, London                   | (74.354)   |
| ZAR  | 29.003.706       | 09/07/2024       | USD     | 1.536.185              | Morgan Stanley, London                   | (16.910)   |
| USD  | 110.000          | 09/07/2024       | ZAR     | 2.106.841              | Merrill Lynch International Bank         | (361)  |
| USD  | 110.000          | 09/07/2024       | ZAR     | 2.101.287              | Morgan Stanley, London                   | (70)   |
| PLN  | 6.455.408        | 15/07/2024       | USD     | 1.621.086              | Barclays Bank, London                    | (4.285)  |
| THB  | 25.516.609       | 17/07/2024       | USD     | 710.413                | Standard Chartered Bank, London          | (4.852)  |
| USD  | 50.000           | 17/07/2024       | THB     | 1.809.035              | Standard Chartered Bank, London          | (22)   |
| HUF  | 22.713.498       | 18/07/2024       | USD     | 61.968                 | Merrill Lynch International Bank         | (63)   |
| USD  | 1.026.126        | 24/07/2024       | CLP     | 1.012.911.247          | Goldman Sachs International, London      | (4.028)  |
| BRL  | 1.104.301        | 02/08/2024       | USD     | 219.316                | Citibank, New York                       | (1.234)  |
| <b>USD</b>                                 |                  |                  |         |                        |  | <b>(1.079.877)</b>   |

# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

| Teilfonds          | Im Austausch für | Erfüllungstermin | Währung | Kontrakt zur Lieferung | Kontrahent                          | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|--------------------|------------------|------------------|---------|------------------------|-------------------------------------|--|
| <b>Global Bond</b> |                  |                  |         |                        |                                     |  |
| EUR                | 1.430.000        | 10/04/2024       | USD     | 1.540.382              | HSBC, Sheffield                     | 4.575  |
| EUR                | 100.000          | 10/04/2024       | USD     | 107.957                | Merrill Lynch International Bank    | 82   |
| USD                | 108.429          | 10/04/2024       | EUR     | 100.000                | UBS, London                         | 390  |
| USD                | 54.430           | 10/04/2024       | EUR     | 50.000                 | Merrill Lynch International Bank    | 411  |
| USD                | 87.539           | 10/04/2024       | EUR     | 80.000                 | HSBC, Sheffield                     | 1.107  |
| USD                | 109.410          | 10/04/2024       | EUR     | 100.000                | State Street Bank and Trust Company | 1.371  |
| USD                | 43.814           | 10/04/2024       | EUR     | 40.000                 | J.P. Morgan Chase Bank, New York    | 598  |
| USD                | 109.542          | 10/04/2024       | EUR     | 100.000                | Merrill Lynch International Bank    | 1.503  |
| USD                | 65.437           | 10/04/2024       | EUR     | 60.000                 | Merrill Lynch International Bank    | 614  |
| USD                | 303.640          | 10/04/2024       | EUR     | 280.000                | UBS, London                         | 1.131  |
| USD                | 355.668          | 11/04/2024       | JPY     | 52.000.000             | NatWest National Westminster Bank   | 11.559   |
| GBP                | 820.000          | 11/04/2024       | USD     | 1.035.466              | NatWest National Westminster Bank   | 446  |
| USD                | 82.825           | 11/04/2024       | JPY     | 12.300.000             | NatWest National Westminster Bank   | 1.430  |
| USD                | 61.394           | 11/04/2024       | GBP     | 48.000                 | HSBC, Sheffield                     | 755  |
| USD                | 944.710          | 26/04/2024       | NZD     | 1.540.000              | NatWest National Westminster Bank   | 23.536   |
| CNY                | 750.000          | 26/04/2024       | USD     | 104.332                | NatWest National Westminster Bank   | 45   |
| USD                | 146.376          | 26/04/2024       | CNY     | 1.050.000              | NatWest National Westminster Bank   | 247  |
| KRW                | 60.000.000       | 26/04/2024       | USD     | 44.536                 | Merrill Lynch International Bank    | 13   |
| INR                | 29.000.000       | 30.04.2024       | USD     | 347.332                | BNP Paribas                         | 186  |
| IDR                | 2.800.000.000    | 30.04.2024       | USD     | 175.923                | UBS, London                         | 319  |
|                    |                  |                  |         |                        | <b>USD</b>                          | <b>50.318</b>  |
| USD                | 651.519          | 10/04/2024       | AUD     | 1.000.000              | UBS, London                         | (1.012)  |
| CAD                | 615.000          | 10/04/2024       | USD     | 455.029                | UBS, London                         | (514)  |
| EUR                | 150.000          | 10/04/2024       | USD     | 162.095                | Merrill Lynch International Bank    | (36)   |
| CAD                | 45.000           | 10/04/2024       | USD     | 33.452                 | NatWest National Westminster Bank   | (195)  |
| AUD                | 60.000           | 10/04/2024       | USD     | 39.190                 | BNP Paribas                         | (38)   |
| CAD                | 30.000           | 10/04/2024       | USD     | 22.215                 | NatWest National Westminster Bank   | (43)   |
| EUR                | 50.000           | 10/04/2024       | USD     | 54.342                 | Crédit Agricole                     | (322)  |
| EUR                | 100.000          | 10/04/2024       | USD     | 108.683                | NatWest National Westminster Bank   | (644)  |
| EUR                | 60.000           | 10/04/2024       | USD     | 65.193                 | NatWest National Westminster Bank   | (370)  |
| EUR                | 70.000           | 10/04/2024       | USD     | 75.779                 | Crédit Agricole                     | (152)  |
| EUR                | 530.000          | 10/04/2024       | USD     | 575.848                | HSBC, Sheffield                     | (3.241)  |
| EUR                | 53.000           | 10/04/2024       | USD     | 57.863                 | BNP Paribas                         | (602)  |
| CAD                | 80.000           | 10/04/2024       | USD     | 59.387                 | Merrill Lynch International Bank    | (263)  |
| EUR                | 40.000           | 10/04/2024       | USD     | 43.871                 | Merrill Lynch International Bank    | (655)  |
| CAD                | 382.000          | 10/04/2024       | USD     | 282.448                | HSBC, Sheffield                     | (132)  |
| EUR                | 80.000           | 10/04/2024       | USD     | 86.594                 | HSBC, Sheffield                     | (163)  |
| EUR                | 40.000           | 10/04/2024       | USD     | 43.450                 | NatWest National Westminster Bank   | (234)  |
| USD                | 126.131          | 11/04/2024       | GBP     | 100.000                | State Street Bank and Trust Company | (199)  |
| JPY                | 243.300.000      | 11/04/2024       | USD     | 1.658.506              | HSBC, Sheffield                     | (48.474)   |
| JPY                | 18.200.000       | 11/04/2024       | USD     | 122.964                | Citigroup Global Markets Limited    | (2.526)  |

# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

| Teilfonds                        | Im Austausch für | Erfüllungstermin | Währung | Kontrakt zur Lieferung | Kontrahent                          | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|----------------------------------|------------------|------------------|---------|------------------------|-------------------------------------|--|
| <b>Global Bond (Fortsetzung)</b> |                  |                  |         |                        |                                     |  |
| USD                              | 692.343          | 11/04/2024       | GBP     | 550.000                | NatWest National Westminster Bank   | (2.475)  |
| GBP                              | 35.000           | 11/04/2024       | USD     | 44.299                 | HSBC, Sheffield                     | (84)   |
| JPY                              | 8.200.000        | 11/04/2024       | USD     | 54.720                 | Crédit Agricole                     | (456)  |
| USD                              | 164.195          | 11/04/2024       | GBP     | 130.000                | UBS, London                         | (35)   |
| JPY                              | 4.000.000        | 11/04/2024       | USD     | 26.913                 | BNP Paribas                         | (443)  |
| JPY                              | 15.200.000       | 11/04/2024       | USD     | 103.113                | Merrill Lynch International Bank    | (2.527)  |
| JPY                              | 29.000.000       | 11/04/2024       | USD     | 198.637                | HSBC, Sheffield                     | (6.730)  |
| GBP                              | 123.000          | 11/04/2024       | USD     | 156.708                | HSBC, Sheffield                     | (1.321)  |
| IDR                              | 2.450.000.000    | 26/04/2024       | USD     | 156.038                | Merrill Lynch International Bank    | (1.781)  |
| KRW                              | 100.000.000      | 26/04/2024       | USD     | 74.987                 | UBS, London                         | (738)  |
| CNY                              | 6.200.000        | 26/04/2024       | USD     | 871.086                | Crédit Agricole                     | (8.230)  |
| SGD                              | 387.000          | 26/04/2024       | USD     | 290.235                | Citigroup Global Markets Limited    | (3.163)  |
| USD                              | 54.634           | 26/04/2024       | PLN     | 220.000                | NatWest National Westminster Bank   | (523)  |
| NOK                              | 300.000          | 26/04/2024       | USD     | 28.705                 | NatWest National Westminster Bank   | (1.036)  |
| DKK                              | 500.000          | 26/04/2024       | USD     | 73.385                 | NatWest National Westminster Bank   | (907)  |
| SEK                              | 880.000          | 26/04/2024       | USD     | 84.606                 | NatWest National Westminster Bank   | (2.230)  |
| CHF                              | 160.000          | 26/04/2024       | USD     | 186.763                | State Street Bank and Trust Company | (8.671)  |
| USD                              | 85.953           | 26/04/2024       | MXN     | 1.500.000              | State Street Bank and Trust Company | (3.955)  |
| CNY                              | 330.000          | 26/04/2024       | USD     | 46.186                 | Crédit Agricole                     | (260)  |
| CNY                              | 470.000          | 26/04/2024       | USD     | 65.888                 | BNP Paribas                         | (478)  |
| CNY                              | 660.000          | 26/04/2024       | USD     | 91.908                 | BNP Paribas                         | (55)   |
| PLN                              | 857.000          | 26/04/2024       | USD     | 217.885                | State Street Bank and Trust Company | (3.022)  |
| AUD                              | 530.000          | 30.04.2024       | USD     | 350.607                | Merrill Lynch International Bank    | (4.567)  |
| JPY                              | 104.400.000      | 30.04.2024       | USD     | 716.219                | Merrill Lynch International Bank    | (23.351)   |
| JPY                              | 4.000.000        | 30.04.2024       | USD     | 27.013                 | NatWest National Westminster Bank   | (467)  |
| USD                              | 97.380           | 06/06/2024       | EUR     | 90.000                 | UBS, London                         | (72)   |
| <b>USD</b>                       |                  |                  |         |                        |                                     | <b>(137.392)</b>   |
| <b>Global Bond Total Return</b>  |                  |                  |         |                        |                                     |  |
| USD                              | 4.290.462        | 10/04/2024       | EUR     | 3.950.000              | Crédit Agricole                     | 22.923   |
| USD                              | 649.654          | 10/04/2024       | EUR     | 600.000                | Crédit Agricole                     | 1.420  |
| AUD                              | 460.000          | 10/04/2024       | USD     | 299.626                | Crédit Agricole                     | 538  |
| USD                              | 216.087          | 10/04/2024       | EUR     | 200.000                | HSBC, Sheffield                     | 9  |
| EUR                              | 1.500.000        | 10/04/2024       | USD     | 1.619.349              | Merrill Lynch International Bank    | 1.235  |
| EUR                              | 380.000          | 10/04/2024       | USD     | 408.642                | Crédit Agricole                     | 1.906  |
| USD                              | 489.252          | 10/04/2024       | EUR     | 450.000                | UBS, London                         | 3.076  |
| USD                              | 1.301.150        | 10/04/2024       | EUR     | 1.200.000              | UBS, London                         | 4.683  |
| USD                              | 945.505          | 10/04/2024       | EUR     | 870.000                | State Street Bank and Trust Company | 5.566  |
| USD                              | 2.081.572        | 10/04/2024       | EUR     | 1.900.000              | State Street Bank and Trust Company | 28.832   |
| USD                              | 2.955.569        | 10/04/2024       | EUR     | 2.700.000              | NatWest National Westminster Bank   | 38.517   |

# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

| Teilfonds                                     | Im Austausch für | Erfüllungstermin | Währung | Kontrakt zur Lieferung | Kontrahent                          | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|---|------------------|------------------|---------|------------------------|-------------------------------------|--|
| <b>Global Bond Total Return (Fortsetzung)</b> |                  |                  |         |                        |                                     |  |
| USD   | 1.422.330        | 10/04/2024       | EUR     | 1.300.000              | State Street Bank and Trust Company | 17.824   |
| USD   | 1.019.808        | 10/04/2024       | GBP     | 800.000                | Merrill Lynch International Bank    | 9.169  |
| USD   | 921.763          | 10/04/2024       | EUR     | 850.000                | UBS, London                         | 3.432  |
| USD   | 217.019          | 10/04/2024       | EUR     | 200.000                | Crédit Agricole                     | 941  |
| USD   | 1.550.989        | 10/04/2024       | EUR     | 1.420.000              | State Street Bank and Trust Company | 16.836   |
| USD   | 1.190.874        | 10/04/2024       | EUR     | 1.100.000              | Merrill Lynch International Bank    | 2.446  |
| USD   | 513.229          | 11/04/2024       | GBP     | 400.000                | NatWest National Westminster Bank   | 7.906  |
| USD   | 1.092.351        | 11/04/2024       | GBP     | 850.000                | J.P. Morgan Chase Bank, New York    | 18.541   |
| USD   | 115.671          | 11/04/2024       | GBP     | 90.000                 | Merrill Lynch International Bank    | 1.973  |
| USD   | 1.127.661        | 11/04/2024       | GBP     | 890.000                | State Street Bank and Trust Company | 3.318  |
| USD   | 2.778.640        | 26/04/2024       | CNY     | 19.800.000             | Merrill Lynch International Bank    | 23.066   |
| USD   | 4.784.894        | 26/04/2024       | NZD     | 7.800.000              | NatWest National Westminster Bank   | 119.203  |
| USD   | 1.125.135        | 26/04/2024       | CZK     | 25.700.000             | Goldman Sachs International, London | 27.644   |
| USD   | 426.358          | 26/04/2024       | NZD     | 700.000                | HSBC, Sheffield                     | 7.642  |
| USD   | 278.050          | 26/04/2024       | NZD     | 450.000                | J.P. Morgan Chase Bank, New York    | 8.876  |
| USD   | 217.301          | 26/04/2024       | CZK     | 5.025.000              | Crédit Agricole                     | 2.714  |
| USD   | 216.105          | 26/04/2024       | NZD     | 360.000                | Crédit Agricole                     | 766  |
| INR   | 152.000.000      | 30.04.2024       | USD     | 1.820.501              | BNP Paribas                         | 977  |
| IDR   | 14.400.000.000   | 30.04.2024       | USD     | 904.748                | UBS, London                         | 1.642  |
| GBP   | 6                | 30.04.2024       | USD     | 8                      | HSBC Bank PLC                       | -  |
| GBP   | 85.364           | 30.04.2024       | USD     | 107.712                | HSBC Bank PLC                       | 140  |
| GBP   | 208.056          | 30.04.2024       | USD     | 262.525                | HSBC Bank PLC                       | 341  |
| GBP   | 6                | 30.04.2024       | USD     | 8                      | HSBC Bank PLC                       | -  |
| GBP   | 10               | 30.04.2024       | USD     | 13                     | HSBC Bank PLC                       | -  |
| GBP   | 4                | 30.04.2024       | USD     | 6                      | HSBC Bank PLC                       | -  |
| GBP   | 5                | 30.04.2024       | USD     | 6                      | HSBC Bank PLC                       | -  |
| GBP   | 14.628           | 30.04.2024       | USD     | 18.458                 | HSBC Bank PLC                       | 24   |
| USD   | 11.655.929       | 30.04.2024       | EUR     | 10.757.000             | HSBC, Sheffield                     | 24.855   |
|   |                  |                  |         |                        | <b>USD</b>                          | <b>408.981</b>   |
| USD   | 58.944.732       | 10/04/2024       | EUR     | 54.800.000             | HSBC, Sheffield                     | (260.613)  |
| CAD   | 330.000          | 10/04/2024       | USD     | 244.162                | UBS, London                         | (276)  |
| USD   | 5.378.909        | 10/04/2024       | EUR     | 5.000.000              | HSBC, Sheffield                     | (23.039)   |
| EUR   | 1.600.000        | 10/04/2024       | USD     | 1.737.434              | Crédit Agricole                     | (8.811)  |
| EUR   | 380.000          | 10/04/2024       | USD     | 411.869                | NatWest National Westminster Bank   | (1.321)  |
| USD   | 1.160.407        | 11/04/2024       | GBP     | 920.000                | State Street Bank and Trust Company | (1.835)  |
| USD   | 18.416.320       | 11/04/2024       | GBP     | 14.580.000             | Crédit Agricole                     | (2.683)  |
| USD   | 833.604          | 11/04/2024       | GBP     | 660.000                | UBS, London                         | (178)  |
| GBP   | 1.450.000        | 11/04/2024       | USD     | 1.844.806              | UBS, London                         | (13.012)   |
| USD   | 246.667          | 26/04/2024       | PLN     | 1.000.000              | HSBC, Sheffield                     | (4.049)  |
| USD   | 1.067.855        | 26/04/2024       | PLN     | 4.300.000              | NatWest National Westminster Bank   | (10.220)   |
| CNY   | 20.100.000       | 26/04/2024       | USD     | 2.799.360              | State Street Bank and Trust Company | (2.035)  |
| USD   | 210.848          | 26/04/2024       | MXN     | 3.570.000              | BNP Paribas                         | (3.132)  |

# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

| Teilfonds                                     | Im Austausch für | Erfüllungstermin | Währung | Kontrakt zur Lieferung | Kontrahent                          | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|---|------------------|------------------|---------|------------------------|-------------------------------------|--|
| <b>Global Bond Total Return (Fortsetzung)</b> |                  |                  |         |                        |                                     |  |
| CZK   | 30.725.000       | 26/04/2024       | USD     | 1.327.279              | HSBC, Sheffield                     | (15.200)   |
| PLN   | 5.300.000        | 26/04/2024       | USD     | 1.351.662              | State Street Bank and Trust Company | (22.871)   |
| AUD   | 2.700.000        | 30.04.2024       | USD     | 1.786.109              | Merrill Lynch International Bank    | (23.268)   |
| JPY   | 540.000.000      | 30.04.2024       | USD     | 3.704.583              | Merrill Lynch International Bank    | (120.779)  |
| JPY   | 40.200.000       | 30.04.2024       | USD     | 272.182                | UBS, London                         | (5.388)  |
| AUD   | 270.000          | 30.04.2024       | USD     | 176.757                | BNP Paribas                         | (473)  |
| INR   | 9.000.000        | 30.04.2024       | USD     | 108.077                | Citigroup Global Markets Limited    | (226)  |
| EUR   | 907              | 30.04.2024       | USD     | 991                    | HSBC Bank PLC                       | (11)   |
| EUR   | 6                | 30.04.2024       | USD     | 7                      | HSBC Bank PLC                       | -  |
| GBP   | 927              | 30.04.2024       | USD     | 1.185                  | HSBC Bank PLC                       | (13)   |
| USD   | 14               | 30.04.2024       | GBP     | 11                     | HSBC Bank PLC                       | -  |
| GBP   | 12.290.736       | 30.04.2024       | USD     | 15.702.399             | HSBC Bank PLC                       | (173.797)  |
| GBP   | 29.994.622       | 30.04.2024       | USD     | 38.320.529             | HSBC Bank PLC                       | (424.138)  |
| USD   | 466.157          | 30.04.2024       | GBP     | 370.111                | HSBC Bank PLC                       | (1.456)  |
| EUR   | 887              | 30.04.2024       | USD     | 969                    | HSBC Bank PLC                       | (10)   |
| EUR   | 6                | 30.04.2024       | USD     | 6                      | HSBC Bank PLC                       | -  |
| USD   | 12               | 30.04.2024       | EUR     | 11                     | HSBC Bank PLC                       | -  |
| GBP   | 922              | 30.04.2024       | USD     | 1.178                  | HSBC Bank PLC                       | (13)   |
| USD   | 14               | 30.04.2024       | GBP     | 11                     | HSBC Bank PLC                       | -  |
| GBP   | 1.492            | 30.04.2024       | USD     | 1.906                  | HSBC Bank PLC                       | (21)   |
| GBP   | 650              | 30.04.2024       | USD     | 830                    | HSBC Bank PLC                       | (9)  |
| GBP   | 659              | 30.04.2024       | USD     | 842                    | HSBC Bank PLC                       | (9)  |
| GBP   | 2.115.279        | 30.04.2024       | USD     | 2.702.438              | HSBC Bank PLC                       | (29.911)   |
| USD   | 3.802.366        | 30.04.2024       | GBP     | 3.010.000              | HSBC, Sheffield                     | (587)  |
| USD   | 865.600          | 06/06/2024       | EUR     | 800.000                | UBS, London                         | (638)  |
| <b>USD</b>                                    |                  |                  |         |                        |                                     | <b>(1.150.022)</b>   |
| <b>Global Corporate Bond</b>                  |                  |                  |         |                        |                                     |  |
| USD   | 32.578           | 03/04/2024       | EUR     | 30.000                 | Standard Chartered Bank, London     | 175  |
| USD   | 616.421.142      | 04/04/2024       | EUR     | 570.000.000            | Royal Bank of Canada, London        | 747.185  |
| USD   | 21.651.622       | 04/04/2024       | EUR     | 20.000.000             | Royal Bank of Canada, London        | 49.027   |
| USD   | 23.913.762       | 04/04/2024       | EUR     | 22.000.000             | Bank of America                     | 150.908  |
| USD   | 37.889.177       | 04/04/2024       | EUR     | 35.000.000             | Bank of America                     | 84.635   |
| USD   | 578.696          | 30.04.2024       | EUR     | 534.270                | HSBC Bank PLC                       | 1.014  |
| USD   | 357.263          | 30.04.2024       | GBP     | 281.992                | HSBC Bank PLC                       | 984  |
| GBP   | 4.197.903        | 30.04.2024       | USD     | 5.296.910              | HSBC Bank PLC                       | 6.887  |
| USD   | 136.859          | 30.04.2024       | GBP     | 108.221                | HSBC Bank PLC                       | 130  |
| GBP   | 110.456          | 30.04.2024       | USD     | 139.513                | HSBC Bank PLC                       | 41   |
| GBP   | 32               | 30.04.2024       | USD     | 41                     | HSBC Bank PLC                       | -  |
| GBP   | 3.948            | 30.04.2024       | USD     | 4.981                  | HSBC Bank PLC                       | 6  |
| USD   | 319.930.783      | 30.04.2024       | GBP     | 252.600.000            | NatWest National Westminster Bank   | 785.959  |
| USD   | 658.302.780      | 15/05/2024       | EUR     | 600.000.000            | Crédit Agricole                     | 9.179.640  |
| <b>USD</b>                                    |                  |                  |         |                        |                                     | <b>11.006.591</b>  |
| EUR   | 30.000           | 03/04/2024       | USD     | 32.566                 | BNP Paribas                         | (163)  |
| EUR   | 105.105          | 30.04.2024       | USD     | 114.877                | HSBC Bank PLC                       | (1.232)  |

# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

| Teilfonds                                  | Im Austausch für | Erfüllungstermin | Währung | Kontrakt zur Lieferung | Kontrahent                       | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|--|------------------|------------------|---------|------------------------|----------------------------------|--|
| <b>Global Corporate Bond (Fortsetzung)</b> |                  |                  |         |                        |                                  |  |
| EUR  | 567              | 30.04.2024       | USD     | 615                    | HSBC Bank PLC                    | (1)  |
| EUR  | 169.073.304      | 30.04.2024       | USD     | 184.792.725            | HSBC Bank PLC                    | (1.981.151)  |
| EUR  | 233.830          | 30.04.2024       | USD     | 254.348                | HSBC Bank PLC                    | (1.518)  |
| EUR  | 919.851          | 30.04.2024       | USD     | 996.504                | HSBC Bank PLC                    | (1.909)  |
| EUR  | 97.828           | 30.04.2024       | USD     | 106.176                | HSBC Bank PLC                    | (399)  |
| EUR  | 153.034          | 30.04.2024       | USD     | 165.950                | HSBC Bank PLC                    | (481)  |
| EUR  | 40.006           | 30.04.2024       | USD     | 43.334                 | HSBC Bank PLC                    | (78)   |
| USD  | 1.753.450        | 30.04.2024       | EUR     | 1.625.605              | HSBC Bank PLC                    | (4.245)  |
| EUR  | 108.592.199      | 30.04.2024       | USD     | 118.688.451            | HSBC Bank PLC                    | (1.272.450)  |
| EUR  | 249.417          | 30.04.2024       | USD     | 270.157                | HSBC Bank PLC                    | (473)  |
| EUR  | 589.067          | 30.04.2024       | USD     | 638.156                | HSBC Bank PLC                    | (1.223)  |
| EUR  | 52.772           | 30.04.2024       | USD     | 57.162                 | HSBC Bank PLC                    | (103)  |
| GBP  | 753.336.295      | 30.04.2024       | USD     | 962.447.383            | HSBC Bank PLC                    | (10.652.535)   |
| USD  | 199.095          | 30.04.2024       | GBP     | 157.967                | HSBC Bank PLC                    | (486)  |
| USD  | 51.530           | 30.04.2024       | GBP     | 40.801                 | HSBC Bank PLC                    | (20)   |
| USD  | 8.951.422        | 30.04.2024       | GBP     | 7.107.090              | HSBC Bank PLC                    | (27.956)   |
| GBP  | 5.800            | 30.04.2024       | USD     | 7.410                  | HSBC Bank PLC                    | (82)   |
| GBP  | 712.375          | 30.04.2024       | USD     | 910.117                | HSBC Bank PLC                    | (10.073)   |
| USD  | 8.540            | 30.04.2024       | GBP     | 6.780                  | HSBC Bank PLC                    | (27)   |
| CHF  | 7.460.936        | 30.04.2024       | USD     | 8.373.392              | HSBC Bank PLC                    | (65.126)   |
| CHF  | 38.020           | 30.04.2024       | USD     | 42.516                 | HSBC Bank PLC                    | (178)  |
| USD  | 88.166           | 30.04.2024       | CHF     | 79.672                 | HSBC Bank PLC                    | (554)  |
| SGD  | 55.432.763       | 30.04.2024       | USD     | 41.471.722             | HSBC Bank PLC                    | (344.634)  |
| SGD  | 292.108          | 30.04.2024       | USD     | 217.276                | HSBC Bank PLC                    | (553)  |
| SGD  | 24.882           | 30.04.2024       | USD     | 18.514                 | HSBC Bank PLC                    | (53)   |
| SGD  | 318.804          | 30.04.2024       | USD     | 237.192                | HSBC Bank PLC                    | (663)  |
| SGD  | 41.629           | 30.04.2024       | USD     | 30.912                 | HSBC Bank PLC                    | (27)   |
| USD  | 397.568          | 30.04.2024       | SGD     | 536.507                | HSBC Bank PLC                    | (481)  |
| AUD  | 6.055.059        | 30.04.2024       | USD     | 4.006.009              | HSBC Bank PLC                    | (52.636)   |
| AUD  | 33.022           | 30.04.2024       | USD     | 21.579                 | HSBC Bank PLC                    | (18)   |
| USD  | 38.047           | 30.04.2024       | AUD     | 58.599                 | HSBC Bank PLC                    | (212)  |
| <b>USD</b>                                 |                  |                  |         |                        |                                  | <b>(14.421.740)</b>  |
| <b>Global Emerging Markets Bond</b>        |                  |                  |         |                        |                                  |  |
| USD  | 2.819.080        | 26/04/2024       | HUF     | 1.005.346.063          | Merrill Lynch International Bank | 67.996   |
| USD  | 635              | 30.04.2024       | EUR     | 585                    | HSBC Bank PLC                    | 2  |
| USD  | 35.940           | 30.04.2024       | EUR     | 33.181                 | HSBC Bank PLC                    | 63   |
| USD  | 250.339          | 30.04.2024       | EUR     | 231.120                | HSBC Bank PLC                    | 439  |

# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

| Teilfonds   | Im Austausch für | Erfüllungstermin | Währung | Kontrakt zur Lieferung | Kontrahent                       | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|---|------------------|------------------|---------|------------------------|----------------------------------|--|
| <b>Global Emerging Markets Bond (Fortsetzung)</b> |                  |                  |         |                        |                                  |  |
| EUR   | 156.377          | 30.04.2024       | USD     | 168.675                | HSBC Bank PLC                    | 408  |
| GBP   | 1.484.474        | 30.04.2024       | USD     | 1.868.800              | HSBC Bank PLC                    | 6.743  |
| GBP   | 6.192            | 30.04.2024       | USD     | 7.820                  | HSBC Bank PLC                    | 3  |
| GBP   | 40.788           | 30.04.2024       | USD     | 51.518                 | HSBC Bank PLC                    | 15   |
| GBP   | 1.265            | 30.04.2024       | USD     | 1.592                  | HSBC Bank PLC                    | 6  |
| USD   | 15.131           | 30.04.2024       | SGD     | 20.337                 | HSBC Bank PLC                    | 43   |
| AUD   | 49.148           | 30.04.2024       | USD     | 32.048                 | HSBC Bank PLC                    | 41   |
| USD   | 11.110           | 30.04.2024       | AUD     | 16.978                 | HSBC Bank PLC                    | 25   |
| AUD   | 4.701            | 30.04.2024       | USD     | 3.065                  | HSBC Bank PLC                    | 4  |
| USD   | 2.303.688        | 18/06/2024       | EUR     | 2.121.826              | Merrill Lynch International Bank | 4.921  |
| EGP   | 143.130.000      | 24/03/2025       | USD     | 2.600.000              | J.P. Morgan Chase Bank, New York | 78.058   |
| <b>USD</b>  |                  |                  |         |                        |                                  | <b>158.767</b>   |
| HUF   | 1.005.346.063    | 26/04/2024       | USD     | 2.878.646              | BNP Paribas                      | (127.562)  |
| EUR   | 355.525          | 30.04.2024       | USD     | 388.579                | HSBC Bank PLC                    | (4.166)  |
| EUR   | 2.816            | 30.04.2024       | USD     | 3.051                  | HSBC Bank PLC                    | (5)  |
| EUR   | 361.084          | 30.04.2024       | USD     | 394.656                | HSBC Bank PLC                    | (4.231)  |
| EUR   | 2.860            | 30.04.2024       | USD     | 3.098                  | HSBC Bank PLC                    | (5)  |
| EUR   | 17.761           | 30.04.2024       | USD     | 19.412                 | HSBC Bank PLC                    | (208)  |
| EUR   | 141              | 30.04.2024       | USD     | 152                    | HSBC Bank PLC                    | -  |
| EUR   | 34.234.769       | 30.04.2024       | USD     | 37.417.713             | HSBC Bank PLC                    | (401.153)  |
| EUR   | 271.968          | 30.04.2024       | USD     | 294.582                | HSBC Bank PLC                    | (515)  |
| EUR   | 34.661.398       | 30.04.2024       | USD     | 37.884.006             | HSBC Bank PLC                    | (406.152)  |
| EUR   | 275.357          | 30.04.2024       | USD     | 298.253                | HSBC Bank PLC                    | (522)  |
| EUR   | 994.334          | 30.04.2024       | USD     | 1.086.781              | HSBC Bank PLC                    | (11.651)   |
| EUR   | 7.877            | 30.04.2024       | USD     | 8.532                  | HSBC Bank PLC                    | (15)   |
| EUR   | 22.890.806       | 30.04.2024       | USD     | 25.019.056             | HSBC Bank PLC                    | (268.228)  |
| EUR   | 14.057           | 30.04.2024       | USD     | 15.291                 | HSBC Bank PLC                    | (91)   |
| EUR   | 182.210          | 30.04.2024       | USD     | 197.361                | HSBC Bank PLC                    | (345)  |
| EUR   | 13.456           | 30.04.2024       | USD     | 14.604                 | HSBC Bank PLC                    | (55)   |
| EUR   | 16.241           | 30.04.2024       | USD     | 17.612                 | HSBC Bank PLC                    | (51)   |
| EUR   | 47.775           | 30.04.2024       | USD     | 51.750                 | HSBC Bank PLC                    | (93)   |
| USD   | 308.942          | 30.04.2024       | EUR     | 286.417                | HSBC Bank PLC                    | (748)  |
| EUR   | 11.663.979       | 30.04.2024       | USD     | 12.748.425             | HSBC Bank PLC                    | (136.675)  |
| EUR   | 92.695           | 30.04.2024       | USD     | 100.403                | HSBC Bank PLC                    | (176)  |
| EUR   | 30.953.443       | 30.04.2024       | USD     | 33.831.309             | HSBC Bank PLC                    | (362.703)  |
| EUR   | 246.442          | 30.04.2024       | USD     | 266.934                | HSBC Bank PLC                    | (467)  |
| EUR   | 7.536            | 30.04.2024       | USD     | 8.163                  | HSBC Bank PLC                    | (15)   |
| EUR   | 187.579          | 30.04.2024       | USD     | 205.019                | HSBC Bank PLC                    | (2.198)  |
| EUR   | 1.489            | 30.04.2024       | USD     | 1.613                  | HSBC Bank PLC                    | (3)  |
| GBP   | 182.843.463      | 30.04.2024       | USD     | 233.597.151            | HSBC Bank PLC                    | (2.585.494)  |
| GBP   | 11.775           | 30.04.2024       | USD     | 14.918                 | HSBC Bank PLC                    | (41)   |
| USD   | 26.682           | 30.04.2024       | GBP     | 21.170                 | HSBC Bank PLC                    | (65)   |
| GBP   | 468              | 30.04.2024       | USD     | 592                    | HSBC Bank PLC                    | (1)  |

# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

| Teilfonds   | Im Austausch für | Erfüllungstermin | Währung | Kontrakt zur Lieferung | Kontrahent                       | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|---|------------------|------------------|---------|------------------------|----------------------------------|--|
| <b>Global Emerging Markets Bond (Fortsetzung)</b>         |                  |                  |         |                        |                                  |  |
| USD   | 2.829.228        | 30.04.2024       | GBP     | 2.246.300              | HSBC Bank PLC                    | (8.836)  |
| GBP   | 156.193          | 30.04.2024       | USD     | 199.549                | HSBC Bank PLC                    | (2.209)  |
| USD   | 2.448            | 30.04.2024       | GBP     | 1.943                  | HSBC Bank PLC                    | (8)  |
| CHF   | 137              | 30.04.2024       | USD     | 154                    | HSBC Bank PLC                    | (1)  |
| CHF   | 1                | 30.04.2024       | USD     | 1                      | HSBC Bank PLC                    | -  |
| CHF   | 40.157           | 30.04.2024       | USD     | 45.069                 | HSBC Bank PLC                    | (351)  |
| CHF   | 314              | 30.04.2024       | USD     | 350                    | HSBC Bank PLC                    | -  |
| CHF   | 1.347.316        | 30.04.2024       | USD     | 1.512.090              | HSBC Bank PLC                    | (11.761)   |
| CHF   | 10.568           | 30.04.2024       | USD     | 11.780                 | HSBC Bank PLC                    | (12)   |
| USD   | 20.768           | 30.04.2024       | CHF     | 18.767                 | HSBC Bank PLC                    | (130)  |
| SGD   | 4.781.667        | 30.04.2024       | USD     | 3.577.378              | HSBC Bank PLC                    | (29.728)   |
| SGD   | 37.625           | 30.04.2024       | USD     | 27.945                 | HSBC Bank PLC                    | (30)   |
| SGD   | 7.617            | 30.04.2024       | USD     | 5.667                  | HSBC Bank PLC                    | (16)   |
| SGD   | 37.487           | 30.04.2024       | USD     | 27.890                 | HSBC Bank PLC                    | (78)   |
| SGD   | 4.826            | 30.04.2024       | USD     | 3.584                  | HSBC Bank PLC                    | (3)  |
| USD   | 45.156           | 30.04.2024       | SGD     | 60.936                 | HSBC Bank PLC                    | (55)   |
| SGD   | 3.131.468        | 30.04.2024       | USD     | 2.342.791              | HSBC Bank PLC                    | (19.469)   |
| SGD   | 24.518           | 30.04.2024       | USD     | 18.211                 | HSBC Bank PLC                    | (20)   |
| AUD   | 6.241.756        | 30.04.2024       | USD     | 4.129.527              | HSBC Bank PLC                    | (54.259)   |
| AUD   | 594.293          | 30.04.2024       | USD     | 393.183                | HSBC Bank PLC                    | (5.166)  |
| USD   | 4.853            | 30.04.2024       | AUD     | 7.474                  | HSBC Bank PLC                    | (27)   |
| <b>USD</b>  |                  |                  |         |                        |                                  | <b>(4.445.793)</b>   |
| <b>Global Emerging Markets Corporate Sustainable Bond</b> |                  |                  |         |                        |                                  |  |
| USD   | 3.299.305        | 18/06/2024       | EUR     | 3.003.757              | HSBC, Sheffield                  | 45.062   |
| <b>USD</b>  |                  |                  |         |                        |                                  | <b>45.062</b>  |
| EUR   | 958              | 30.04.2024       | USD     | 1.047                  | HSBC Bank PLC                    | (11)   |
| <b>USD</b>  |                  |                  |         |                        |                                  | <b>(11)</b>  |
| <b>Global Emerging Markets ESG Bond</b>                   |                  |                  |         |                        |                                  |  |
| GBP   | 125.687          | 30.04.2024       | USD     | 158.227                | HSBC Bank PLC                    | 570  |
| GBP   | 26.323           | 30.04.2024       | USD     | 33.176                 | HSBC Bank PLC                    | 81   |
| GBP   | 40.888           | 30.04.2024       | USD     | 51.640                 | HSBC Bank PLC                    | 20   |
| GBP   | 1.482            | 30.04.2024       | USD     | 1.872                  | HSBC Bank PLC                    | 1  |
| USD   | 10.030           | 30.04.2024       | EUR     | 9.221                  | HSBC Bank PLC                    | 60   |
| USD   | 60.408           | 18/06/2024       | EUR     | 55.639                 | Merrill Lynch International Bank | 129  |
| EGP   | 14.313.000       | 24/03/2025       | USD     | 260.000                | J.P. Morgan Chase Bank, New York | 7.806  |
| <b>USD</b>  |                  |                  |         |                        |                                  | <b>8.667</b>   |
| EUR   | 16.499.869       | 30.04.2024       | USD     | 18.033.928             | HSBC Bank PLC                    | (193.340)  |
| EUR   | 115.853          | 30.04.2024       | USD     | 125.486                | HSBC Bank PLC                    | (220)  |
| GBP   | 17.484.752       | 30.04.2024       | USD     | 22.338.170             | HSBC Bank PLC                    | (247.243)  |
| GBP   | 6.522            | 30.04.2024       | USD     | 8.263                  | HSBC Bank PLC                    | (23)   |
| GBP   | 51.464           | 30.04.2024       | USD     | 65.082                 | HSBC Bank PLC                    | (61)   |
| USD   | 272.298          | 30.04.2024       | GBP     | 216.194                | HSBC Bank PLC                    | (850)  |
| EUR   | 1.108.180        | 30.04.2024       | USD     | 1.211.212              | HSBC Bank PLC                    | (12.985)   |
| EUR   | 7.779            | 30.04.2024       | USD     | 8.426                  | HSBC Bank PLC                    | (15)   |
| USD   | 14.166           | 30.04.2024       | EUR     | 13.133                 | HSBC Bank PLC                    | (34)   |
| <b>USD</b>  |                  |                  |         |                        |                                  | <b>(454.771)</b>   |



# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

| Teilfonds                                     | Im Austausch für | Erfüllungstermin | Währung | Kontrakt zur Lieferung | Kontrahent                          | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|---|------------------|------------------|---------|------------------------|-------------------------------------|--|
| <b>Global Emerging Markets ESG Local Debt</b> |                  |                  |         |                        |                                     |  |
| USD   | 50.000           | 05/04/2024       | MYR     | 231.940                | Barclays Bank, London               | 1.042  |
| USD   | 200.000          | 05/04/2024       | MYR     | 923.960                | Barclays Bank, London               | 4.970  |
| USD   | 200.000          | 05/04/2024       | MYR     | 938.928                | Morgan Stanley, London              | 1.810  |
| USD   | 450.000          | 05/04/2024       | MYR     | 2.120.216              | Morgan Stanley, London              | 2.463  |
| USD   | 105.000          | 05/04/2024       | MYR     | 495.178                | Morgan Stanley, London              | 477  |
| USD   | 110.000          | 05/04/2024       | MYR     | 520.135                | Barclays Bank, London               | 209  |
| MYR   | 950.174          | 05/04/2024       | USD     | 200.000                | Morgan Stanley, London              | 564  |
| MYR   | 477.007          | 05/04/2024       | USD     | 100.000                | Goldman Sachs International, London | 687  |
| USD   | 125.000          | 05/04/2024       | MYR     | 590.494                | Morgan Stanley, London              | 358  |
| USD   | 125.000          | 05/04/2024       | MYR     | 590.229                | Morgan Stanley, London              | 414  |
| USD   | 3.085.132        | 05/04/2024       | MYR     | 14.413.737             | Morgan Stanley, London              | 42.665   |
| USD   | 600.000          | 17/04/2024       | EGP     | 23.610.000             | Standard Chartered Bank, London     | 103.601  |
| USD   | 135.060          | 17/04/2024       | EGP     | 5.314.625              | Standard Chartered Bank, London     | 23.321   |
| USD   | 325.000          | 24/04/2024       | THB     | 11.482.510             | Standard Chartered Bank, London     | 9.742  |
| USD   | 100.000          | 24/04/2024       | THB     | 3.557.830              | Standard Chartered Bank, London     | 2.318  |
| USD   | 50.000           | 24/04/2024       | THB     | 1.793.125              | Standard Chartered Bank, London     | 769  |
| USD   | 450.000          | 24/04/2024       | THB     | 16.105.590             | Standard Chartered Bank, London     | 7.813  |
| USD   | 250.000          | 24/04/2024       | THB     | 8.962.850              | Standard Chartered Bank, London     | 3.921  |
| USD   | 150.000          | 24/04/2024       | THB     | 5.391.870              | Standard Chartered Bank, London     | 1.964  |
| USD   | 12.638.420       | 24/04/2024       | THB     | 456.436.547            | Standard Chartered Bank, London     | 106.729  |
| USD   | 150.000          | 24/04/2024       | THB     | 5.452.860              | Standard Chartered Bank, London     | 289  |
| USD   | 1.348.247        | 25/04/2024       | PLN     | 5.362.208              | Barclays Bank, London               | 3.849  |
| USD   | 100.000          | 25/04/2024       | PLN     | 397.902                | Barclays Bank, London               | 239  |
| PLN   | 4.415.000        | 25/04/2024       | USD     | 1.100.758              | Deutsche Bank, London               | 6.159  |
| PLN   | 506.077          | 25/04/2024       | USD     | 125.000                | J.P. Morgan Chase Bank, New York    | 1.882  |
| PLN   | 1.006.458        | 25/04/2024       | USD     | 250.000                | Barclays Bank, London               | 2.336  |
| PLN   | 2.114.204        | 25/04/2024       | USD     | 530.000                | Merrill Lynch International Bank    | 68   |
| PLN   | 404.870          | 25/04/2024       | USD     | 100.000                | Merrill Lynch International Bank    | 1.508  |
| PLN   | 401.729          | 25/04/2024       | USD     | 100.000                | Citibank, New York                  | 721  |
| USD   | 50.000           | 25/04/2024       | PLN     | 198.778                | J.P. Morgan Chase Bank, New York    | 163  |
| USD   | 100.000          | 25/04/2024       | PLN     | 397.186                | Morgan Stanley, London              | 419  |
| PLN   | 997.179          | 25/04/2024       | USD     | 250.000                | Morgan Stanley, London              | 10   |
| USD   | 225.000          | 25/04/2024       | PLN     | 887.758                | Barclays Bank, London               | 2.424  |
| USD   | 200.000          | 25/04/2024       | PLN     | 794.677                | J.P. Morgan Chase Bank, New York    | 761  |
| USD   | 225.000          | 25/04/2024       | PLN     | 895.485                | UBS, London                         | 486  |

# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

| Teilfonds   | Im Austausch für | Erfüllungstermin | Währung | Kontrakt zur Lieferung | Kontrahent                          | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|---|------------------|------------------|---------|------------------------|-------------------------------------|--|
| <b>Global Emerging Markets ESG Local Debt (Fortsetzung)</b> |                  |                  |         |                        |                                     |  |
| .   | 180.000          | 26/04/2024       | HUF     | 63.733.392             | Morgan Stanley, London              | 5.597  |
| USD   | 50.000           | 26/04/2024       | HUF     | 17.931.420             | Morgan Stanley, London              | 931  |
| USD   | 50.000           | 26/04/2024       | HUF     | 18.145.535             | Barclays Bank, London               | 346  |
| USD   | 50.000           | 26/04/2024       | HUF     | 18.044.160             | Citibank, New York                  | 623  |
| USD   | 50.000           | 26/04/2024       | HUF     | 18.107.205             | Citibank, New York                  | 450  |
| USD   | 256.425          | 26/04/2024       | HUF     | 93.570.000             | Barclays Bank, London               | 375  |
| USD   | 50.000           | 26/04/2024       | HUF     | 18.136.181             | J.P. Morgan Chase Bank, New York    | 371  |
| USD   | 100.000          | 26/04/2024       | HUF     | 36.180.834             | J.P. Morgan Chase Bank, New York    | 993  |
| USD   | 100.000          | 26/04/2024       | HUF     | 36.404.731             | BNP Paribas                         | 380  |
| USD   | 100.000          | 26/04/2024       | HUF     | 36.477.720             | Merrill Lynch International Bank    | 180  |
| HUF   | 77.280.000       | 26/04/2024       | USD     | 210.372                | Barclays Bank, London               | 1.102  |
| USD   | 4.691.923        | 26/04/2024       | HUF     | 1.713.243.847          | Merrill Lynch International Bank    | 3.710  |
| JPY   | 12.845.877       | 30.04.2024       | USD     | 85.163                 | HSBC Bank PLC                       | 90   |
| USD   | 476              | 30.04.2024       | JPY     | 71.679                 | HSBC Bank PLC                       | -  |
| USD   | 100.000          | 03/05/2024       | BRL     | 496.630                | Goldman Sachs International, London | 1.089  |
| USD   | 50.000           | 03/05/2024       | BRL     | 248.974                | Deutsche Bank, London               | 413  |
| USD   | 450.000          | 03/05/2024       | BRL     | 2.241.941              | Barclays Bank, London               | 3.484  |
| USD   | 150.000          | 03/05/2024       | BRL     | 746.243                | Deutsche Bank, London               | 1.375  |
| USD   | 150.000          | 03/05/2024       | BRL     | 748.436                | Deutsche Bank, London               | 938  |
| BRL   | 1.011.024        | 03/05/2024       | USD     | 200.000                | Deutsche Bank, London               | 1.361  |
| USD   | 100.000          | 03/05/2024       | BRL     | 497.907                | Deutsche Bank, London               | 834  |
| USD   | 200.000          | 03/05/2024       | BRL     | 999.956                | Barclays Bank, London               | 844  |
| USD   | 50.000           | 03/05/2024       | BRL     | 248.352                | Merrill Lynch International Bank    | 537  |
| USD   | 482.045          | 03/05/2024       | BRL     | 2.413.166              | Citibank, New York                  | 1.427  |
| USD   | 150.000          | 03/05/2024       | BRL     | 752.220                | Morgan Stanley, London              | 184  |
| USD   | 150.000          | 03/05/2024       | BRL     | 750.795                | Morgan Stanley, London              | 468  |
| USD   | 1.720.000        | 03/05/2024       | BRL     | 8.602.580              | Citibank, New York                  | 6.668  |
| USD   | 100.000          | 03/05/2024       | BRL     | 499.890                | Morgan Stanley, London              | 439  |
| USD   | 659.187          | 10/05/2024       | CLP     | 601.131.520            | BNP Paribas                         | 47.024   |
| USD   | 150.000          | 10/05/2024       | CLP     | 137.266.500            | Morgan Stanley, London              | 10.215   |
| USD   | 50.000           | 10/05/2024       | CLP     | 45.806.990             | BNP Paribas                         | 3.352  |
| USD   | 75.000           | 10/05/2024       | CLP     | 72.399.000             | Crédit Agricole                     | 1.272  |
| USD   | 1.570.000        | 10/05/2024       | CLP     | 1.539.228.000          | Merrill Lynch International Bank    | 2.526  |
| USD   | 1.440.000        | 10/05/2024       | CLP     | 1.405.440.000          | Merrill Lynch International Bank    | 8.769  |
| USD   | 1.500.000        | 10/05/2024       | CLP     | 1.463.565.000          | Standard Chartered Bank, London     | 9.578  |
| USD   | 25.000           | 10/05/2024       | CLP     | 24.441.013             | UBS, London                         | 110  |
| USD   | 1.960.000        | 10/05/2024       | CLP     | 1.918.840.000          | Standard Chartered Bank, London     | 5.948  |
| CLP   | 4.881.393.523    | 10/05/2024       | USD     | 4.951.349              | Goldman Sachs International, London | 19.621   |
| RSD   | 27.116.025       | 13/05/2024       | USD     | 250.000                | BNP Paribas                         | 82   |
| USD   | 753.983          | 16/05/2024       | RON     | 3.463.229              | BNP Paribas                         | 1.875  |
| USD   | 670.000          | 16/05/2024       | RON     | 3.072.701              | J.P. Morgan Chase Bank, New York    | 2.702  |
| RON   | 232.094          | 16/05/2024       | USD     | 50.000                 | BNP Paribas                         | 404  |

# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

| Teilfonds   | Im Austausch für | Erfüllungstermin | Währung | Kontrakt zur Lieferung | Kontrahent                          | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|---|------------------|------------------|---------|------------------------|-------------------------------------|--|
| <b>Global Emerging Markets ESG Local Debt (Fortsetzung)</b> |                  |                  |         |                        |                                     |  |
| RON   | 115.510          | 16/05/2024       | USD     | 25.000                 | BNP Paribas                         | 85   |
| USD   | 50.000           | 16/05/2024       | RON     | 229.225                | Standard Chartered Bank, London     | 219  |
| USD   | 375.000          | 16/05/2024       | RON     | 1.716.864              | Merrill Lynch International Bank    | 2.149  |
| USD   | 100.000          | 16/05/2024       | RON     | 457.126                | Merrill Lynch International Bank    | 726  |
| USD   | 100.000          | 16/05/2024       | RON     | 457.516                | Merrill Lynch International Bank    | 641  |
| USD   | 125.000          | 16/05/2024       | RON     | 572.938                | Merrill Lynch International Bank    | 575  |
| USD   | 100.000          | 16/05/2024       | RON     | 460.083                | Merrill Lynch International Bank    | 84   |
| USD   | 25.000           | 16/05/2024       | RON     | 114.761                | UBS, London                         | 77   |
| USD   | 25.000           | 16/05/2024       | RON     | 114.945                | Merrill Lynch International Bank    | 37   |
| PEN   | 388.002          | 22/05/2024       | USD     | 100.000                | Goldman Sachs International, London | 4.182  |
| PEN   | 188.423          | 22/05/2024       | USD     | 50.000                 | Morgan Stanley, London              | 593  |
| USD   | 25.000           | 22/05/2024       | PEN     | 92.315                 | Merrill Lynch International Bank    | 213  |
| USD   | 50.000           | 22/05/2024       | PEN     | 184.857                | Morgan Stanley, London              | 365  |
| USD   | 50.000           | 22/05/2024       | PEN     | 184.745                | Goldman Sachs International, London | 394  |
| USD   | 25.000           | 22/05/2024       | PEN     | 92.648                 | Merrill Lynch International Bank    | 123  |
| USD   | 1.164.399        | 23/05/2024       | CZK     | 27.021.042             | Morgan Stanley, London              | 10.417   |
| USD   | 75.000           | 23/05/2024       | CZK     | 1.753.819              | UBS, London                         | 100  |
| USD   | 387.296          | 23/05/2024       | CZK     | 9.060.000              | Barclays Bank, London               | 372  |
| USD   | 147.580          | 23/05/2024       | CZK     | 3.455.000              | Barclays Bank, London               | 28   |
| USD   | 100.000          | 23/05/2024       | CZK     | 2.327.976              | Goldman Sachs International, London | 580  |
| USD   | 150.000          | 23/05/2024       | CZK     | 3.462.821              | Goldman Sachs International, London | 2.114  |
| USD   | 150.000          | 23/05/2024       | CZK     | 3.478.704              | Merrill Lynch International Bank    | 1.436  |
| USD   | 200.000          | 23/05/2024       | CZK     | 4.645.688              | Citibank, New York                  | 1.598  |
| USD   | 150.000          | 23/05/2024       | CZK     | 3.512.292              | Citibank, New York                  | 1  |
| USD   | 75.000           | 23/05/2024       | CZK     | 1.750.749              | UBS, London                         | 231  |
| USD   | 5.826.755        | 24/05/2024       | TWD     | 181.113.015            | Crédit Agricole                     | 151.588  |
| USD   | 50.000           | 24/05/2024       | TWD     | 1.554.055              | Crédit Agricole                     | 1.304  |
| USD   | 25.000           | 24/05/2024       | TWD     | 785.035                | Crédit Agricole                     | 401  |
| USD   | 50.000           | 24/05/2024       | TWD     | 1.567.700              | BNP Paribas                         | 876  |
| EGP   | 36.503.750       | 28/05/2024       | USD     | 725.000                | J.P. Morgan Chase Bank, New York    | 34.895   |
| USD   | 808.499          | 28/05/2024       | EGP     | 36.503.750             | J.P. Morgan Chase Bank, New York    | 48.605   |
| COP   | 406.568.480      | 07/06/2024       | USD     | 100.000                | BNP Paribas                         | 4.051  |
| COP   | 400.112.000      | 07/06/2024       | USD     | 100.000                | Merrill Lynch International Bank    | 2.398  |
| COP   | 200.272.500      | 07/06/2024       | USD     | 50.000                 | BNP Paribas                         | 1.255  |
| COP   | 198.603.965      | 07/06/2024       | USD     | 50.000                 | BNP Paribas                         | 828  |
| MXN   | 3.453.831        | 11/06/2024       | USD     | 200.000                | Standard Chartered Bank, London     | 5.528  |
| EGP   | 13.000.000       | 11/06/2024       | USD     | 260.000                | Goldman Sachs International, London | 9.606  |
| MXN   | 1.706.627        | 11/06/2024       | USD     | 100.000                | BNP Paribas                         | 1.557  |
| MXN   | 105.438.440      | 11/06/2024       | USD     | 6.177.437              | Morgan Stanley, London              | 96.917   |
| MXN   | 4.300.000        | 11/06/2024       | USD     | 254.455                | Morgan Stanley, London              | 1.426  |
| USD   | 1.838.679        | 12/06/2024       | IDR     | 28.694.235.965         | BNP Paribas                         | 34.838   |

# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

| Teilfonds   | Im Austausch für | Erfüllungstermin | Währung | Kontrakt zur Lieferung | Kontrahent                          | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|---|------------------|------------------|---------|------------------------|-------------------------------------|--|
| <b>Global Emerging Markets ESG Local Debt (Fortsetzung)</b> |                  |                  |         |                        |                                     |  |
| USD   | 275.000          | 12/06/2024       | IDR     | 4.306.005.000          | Morgan Stanley, London              | 4.306  |
| USD   | 75.000           | 12/06/2024       | IDR     | 1.177.537.500          | BNP Paribas                         | 975  |
| USD   | 420.000          | 12/06/2024       | IDR     | 6.612.774.000          | BNP Paribas                         | 4.293  |
| USD   | 50.000           | 12/06/2024       | IDR     | 784.880.000            | BNP Paribas                         | 659  |
| USD   | 225.000          | 12/06/2024       | IDR     | 3.524.287.500          | Morgan Stanley, London              | 3.448  |
| USD   | 200.000          | 12/06/2024       | IDR     | 3.152.680.000          | Merrill Lynch International Bank    | 1.809  |
| USD   | 250.000          | 12/06/2024       | IDR     | 3.943.400.000          | Merrill Lynch International Bank    | 2.101  |
| USD   | 150.000          | 12/06/2024       | IDR     | 2.379.525.000          | Morgan Stanley, London              | 413  |
| USD   | 125.000          | 12/06/2024       | IDR     | 1.977.562.500          | BNP Paribas                         | 682  |
| USD   | 25.000           | 14/06/2024       | CNY     | 177.598                | Goldman Sachs International, London | 173  |
| USD   | 210.000          | 14/06/2024       | CNY     | 1.490.496              | Barclays Bank, London               | 1.635  |
| USD   | 50.000           | 14/06/2024       | CNY     | 354.474                | Goldman Sachs International, London | 446  |
| USD   | 150.000          | 14/06/2024       | CNY     | 1.064.430              | BNP Paribas                         | 1.197  |
| USD   | 125.000          | 14/06/2024       | CNY     | 886.009                | Goldman Sachs International, London | 1.140  |
| USD   | 125.000          | 14/06/2024       | CNY     | 887.563                | Barclays Bank, London               | 923  |
| USD   | 5.700.000        | 14/06/2024       | CNY     | 40.737.900             | BNP Paribas                         | 5.020  |
| USD   | 100.000          | 14/06/2024       | CNY     | 714.420                | Barclays Bank, London               | 127  |
| USD   | 75.000           | 14/06/2024       | CNY     | 534.008                | Crédit Agricole                     | 348  |
| USD   | 25.000           | 14/06/2024       | CNY     | 178.030                | Barclays Bank, London               | 112  |
| USD   | 25.000           | 18/06/2024       | EUR     | 22.879                 | Barclays Bank, London               | 213  |
| USD   | 25.000           | 18/06/2024       | EUR     | 22.886                 | BNP Paribas                         | 206  |
| USD   | 25.000           | 18/06/2024       | EUR     | 22.952                 | BNP Paribas                         | 134  |
| USD   | 25.000           | 18/06/2024       | EUR     | 23.032                 | Merrill Lynch International Bank    | 47   |
| USD   | 2.930.800        | 24/06/2024       | SGD     | 3.918.254              | Standard Chartered Bank, London     | 16.633   |
| USD   | 150.000          | 25/06/2024       | MYR     | 702.180                | Barclays Bank, London               | 2.333  |
| USD   | 200.000          | 25/06/2024       | MYR     | 939.120                | Barclays Bank, London               | 2.505  |
| USD   | 225.000          | 25/06/2024       | MYR     | 1.065.026              | Morgan Stanley, London              | 1.028  |
| USD   | 150.000          | 25/06/2024       | MYR     | 708.645                | Crédit Agricole                     | 974  |
| USD   | 75.000           | 25/06/2024       | MYR     | 353.153                | Barclays Bank, London               | 733  |
| USD   | 25.000           | 25/06/2024       | MYR     | 118.175                | Barclays Bank, London               | 148  |
| USD   | 1.503.512        | 02/07/2024       | BRL     | 7.500.000              | Barclays Bank, London               | 17.981   |
| TRY   | 553.036          | 05/07/2024       | USD     | 15.000                 | BNP Paribas                         | 308  |
| TRY   | 5.148.658        | 05/07/2024       | USD     | 140.000                | Standard Chartered Bank, London     | 2.511  |
| TRY   | 46.243           | 05/07/2024       | USD     | 1.253                  | BNP Paribas                         | 27   |
| USD   | 303.194          | 09/07/2024       | ZAR     | 5.724.400              | Morgan Stanley, London              | 3.337  |
| USD   | 200.000          | 09/07/2024       | ZAR     | 3.785.238              | BNP Paribas                         | 1.721  |
| USD   | 200.000          | 09/07/2024       | ZAR     | 3.795.892              | Merrill Lynch International Bank    | 1.163  |
| USD   | 100.000          | 09/07/2024       | ZAR     | 1.908.933              | Merrill Lynch International Bank    | 6  |
| USD   | 25.000           | 09/07/2024       | ZAR     | 476.137                | Morgan Stanley, London              | 59   |

# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

| Teilfonds   | Im Austausch für | Erfüllungstermin | Währung | Kontrakt zur Lieferung | Kontrahent                          | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|---|------------------|------------------|---------|------------------------|-------------------------------------|--|
| <b>Global Emerging Markets ESG Local Debt (Fortsetzung)</b> |                  |                  |         |                        |                                     |  |
| USD   | 125.000          | 15/07/2024       | PLN     | 497.583                | Morgan Stanley, London              | 377  |
| USD   | 1.537.702        | 15/07/2024       | PLN     | 6.123.360              | Barclays Bank, London               | 4.064  |
| USD   | 50.000           | 15/07/2024       | PLN     | 199.560                | Goldman Sachs International, London | 19   |
| USD   | 200.000          | 17/07/2024       | THB     | 7.186.860              | Standard Chartered Bank, London     | 1.276  |
| USD   | 151.071          | 17/07/2024       | THB     | 5.452.860              | Standard Chartered Bank, London     | 294  |
| USD   | 1.567.087        | 02/08/2024       | BRL     | 7.905.345              | Barclays Bank, London               | 5.906  |
| USD   | 50.000           | 02/08/2024       | BRL     | 251.864                | Goldman Sachs International, London | 261  |
| EGP   | 38.626.000       | 24/03/2025       | USD     | 700.000                | Standard Chartered Bank, London     | 22.718   |
| <b>USD</b>  |                  |                  |         |                        |                                     | <b>1.026.040</b>   |
| MYR   | 15.280.513       | 05/04/2024       | USD     | 3.284.648              | Barclays Bank, London               | (59.221)   |
| MYR   | 921.560          | 05/04/2024       | USD     | 200.000                | Barclays Bank, London               | (5.476)  |
| MYR   | 1.909.858        | 05/04/2024       | USD     | 420.000                | Morgan Stanley, London              | (16.865)   |
| MYR   | 235.105          | 05/04/2024       | USD     | 50.000                 | Barclays Bank, London               | (374)  |
| MYR   | 472.600          | 05/04/2024       | USD     | 100.000                | Crédit Agricole                     | (243)  |
| MYR   | 1.061.393        | 05/04/2024       | USD     | 225.000                | Crédit Agricole                     | (960)  |
| USD   | 200.000          | 05/04/2024       | MYR     | 953.840                | Crédit Agricole                     | (1.338)  |
| USD   | 50.000           | 05/04/2024       | MYR     | 238.665                | Barclays Bank, London               | (378)  |
| USD   | 50.000           | 05/04/2024       | MYR     | 238.097                | Morgan Stanley, London              | (258)  |
| MYR   | 947.208          | 05/04/2024       | USD     | 200.000                | Goldman Sachs International, London | (62)   |
| EGP   | 28.924.625       | 17/04/2024       | USD     | 745.000                | Standard Chartered Bank, London     | (136.862)  |
| THB   | 426.865.911      | 24/04/2024       | USD     | 12.494.246             | Standard Chartered Bank, London     | (774.431)  |
| THB   | 7.029.820        | 24/04/2024       | USD     | 200.000                | Standard Chartered Bank, London     | (6.993)  |
| THB   | 8.859.100        | 24/04/2024       | USD     | 250.000                | Standard Chartered Bank, London     | (6.769)  |
| THB   | 9.354.129        | 24/04/2024       | USD     | 265.000                | Standard Chartered Bank, London     | (8.178)  |
| THB   | 7.992.945        | 24/04/2024       | USD     | 225.000                | Standard Chartered Bank, London     | (5.550)  |
| THB   | 6.172.478        | 24/04/2024       | USD     | 175.000                | Standard Chartered Bank, London     | (5.532)  |
| THB   | 10.568.820       | 24/04/2024       | USD     | 300.000                | Standard Chartered Bank, London     | (9.828)  |
| THB   | 6.329.412        | 24/04/2024       | USD     | 180.000                | Standard Chartered Bank, London     | (6.223)  |
| THB   | 5.348.115        | 24/04/2024       | USD     | 150.000                | Standard Chartered Bank, London     | (3.165)  |
| THB   | 5.376.735        | 24/04/2024       | USD     | 150.000                | Standard Chartered Bank, London     | (2.379)  |
| THB   | 7.158.500        | 24/04/2024       | USD     | 200.000                | Standard Chartered Bank, London     | (3.460)  |
| THB   | 2.674.358        | 24/04/2024       | USD     | 75.000                 | Standard Chartered Bank, London     | (1.574)  |
| THB   | 5.452.860        | 24/04/2024       | USD     | 150.311                | Standard Chartered Bank, London     | (600)  |
| USD   | 465.000          | 25/04/2024       | PLN     | 1.864.934              | UBS, London                         | (2.571)  |
| USD   | 125.000          | 25/04/2024       | PLN     | 505.655                | Deutsche Bank, London               | (1.776)  |
| USD   | 693.356          | 25/04/2024       | PLN     | 2.785.000              | Goldman Sachs International, London | (4.892)  |
| USD   | 100.000          | 25/04/2024       | PLN     | 401.752                | Goldman Sachs International, London | (726)  |
| USD   | 50.000           | 25/04/2024       | PLN     | 199.710                | Morgan Stanley, London              | (71)   |
| USD   | 170.000          | 25/04/2024       | PLN     | 679.189                | UBS, London                         | (285)  |
| USD   | 150.000          | 25/04/2024       | PLN     | 598.642                | Barclays Bank, London               | (90)   |
| PLN   | 6.123.360        | 25/04/2024       | USD     | 1.539.369              | Barclays Bank, London               | (4.136)  |
| HUF   | 1.425.613.908    | 26/04/2024       | USD     | 4.082.015              | BNP Paribas                         | (180.888)  |
| HUF   | 158.875.000      | 26/04/2024       | USD     | 455.505                | BNP Paribas                         | (20.751)   |
| HUF   | 35.470.130       | 26/04/2024       | USD     | 100.000                | BNP Paribas                         | (2.938)  |
| HUF   | 94.925.000       | 26/04/2024       | USD     | 268.062                | Deutsche Bank, London               | (8.304)  |
| HUF   | 18.161.465       | 26/04/2024       | USD     | 50.000                 | Morgan Stanley, London              | (302)  |

# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

| Teilfonds   | Im Austausch für | Erfüllungstermin | Währung | Kontrakt zur Lieferung | Kontrahent                          | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|---|------------------|------------------|---------|------------------------|-------------------------------------|--|
| <b>Global Emerging Markets ESG Local Debt (Fortsetzung)</b> |                  |                  |         |                        |                                     |  |
| HUF   | 35.934.850       | 26/04/2024       | USD     | 100.000                | Merrill Lynch International Bank    | (1.666)  |
| HUF   | 81.896.560       | 26/04/2024       | USD     | 230.000                | Merrill Lynch International Bank    | (5.894)  |
| HUF   | 9.034.475        | 26/04/2024       | USD     | 25.000                 | Merrill Lynch International Bank    | (278)  |
| HUF   | 142.261.275      | 26/04/2024       | USD     | 390.000                | UBS, London                         | (709)  |
| HUF   | 36.498.870       | 26/04/2024       | USD     | 100.000                | Barclays Bank, London               | (123)  |
| USD   | 100.000          | 26/04/2024       | HUF     | 36.789.590             | J.P. Morgan Chase Bank, New York    | (672)  |
| USD   | 25.000           | 26/04/2024       | HUF     | 9.186.918              | Goldman Sachs International, London | (140)  |
| EUR   | 11.940           | 30.04.2024       | USD     | 13.050                 | HSBC Bank PLC                       | (140)  |
| BRL   | 6.583.448        | 03/05/2024       | USD     | 1.321.954              | Goldman Sachs International, London | (10.762)   |
| BRL   | 500.585          | 03/05/2024       | USD     | 100.000                | UBS, London                         | (301)  |
| BRL   | 499.767          | 03/05/2024       | USD     | 100.000                | Goldman Sachs International, London | (464)  |
| BRL   | 1.003.724        | 03/05/2024       | USD     | 200.000                | UBS, London                         | (93)   |
| USD   | 100.000          | 03/05/2024       | BRL     | 503.097                | Goldman Sachs International, London | (199)  |
| BRL   | 501.015          | 03/05/2024       | USD     | 100.000                | Citibank, New York                  | (215)  |
| USD   | 1.460.000        | 03/05/2024       | BRL     | 7.357.670              | Barclays Bank, London               | (5.390)  |
| BRL   | 1.120.547        | 03/05/2024       | USD     | 225.000                | UBS, London                         | (1.826)  |
| BRL   | 7.285.867        | 03/05/2024       | USD     | 1.460.000              | BNP Paribas                         | (8.911)  |
| BRL   | 625.534          | 03/05/2024       | USD     | 125.000                | J.P. Morgan Chase Bank, New York    | (416)  |
| USD   | 175.000          | 03/05/2024       | BRL     | 881.706                | Barclays Bank, London               | (605)  |
| USD   | 200.000          | 03/05/2024       | BRL     | 1.004.384              | Deutsche Bank, London               | (38)   |
| BRL   | 1.957.090        | 03/05/2024       | USD     | 391.967                | Citibank, New York                  | (2.183)  |
| BRL   | 7.905.345        | 03/05/2024       | USD     | 1.580.554              | Barclays Bank, London               | (6.086)  |
| PHP   | 1.417.900        | 09/05/2024       | USD     | 25.419                 | UBS, London                         | (206)  |
| USD   | 25.189           | 09/05/2024       | PHP     | 1.417.900              | Barclays Bank, London               | (25)   |
| CLP   | 162.036.000      | 10/05/2024       | USD     | 175.000                | Barclays Bank, London               | (9.991)  |
| CLP   | 160.524.000      | 10/05/2024       | USD     | 175.000                | Morgan Stanley, London              | (11.530)   |
| CLP   | 47.027.000       | 10/05/2024       | USD     | 50.000                 | Morgan Stanley, London              | (2.110)  |
| CLP   | 206.085.000      | 10/05/2024       | USD     | 220.000                | Morgan Stanley, London              | (10.133)   |
| USD   | 25.000           | 10/05/2024       | CLP     | 24.609.000             | Citibank, New York                  | (61)   |
| CLP   | 24.260.000       | 10/05/2024       | USD     | 25.000                 | Morgan Stanley, London              | (295)  |
| USD   | 25.000           | 10/05/2024       | CLP     | 24.650.250             | Deutsche Bank, London               | (103)  |
| CLP   | 24.101.750       | 10/05/2024       | USD     | 25.000                 | Barclays Bank, London               | (456)  |
| CLP   | 1.751.950.000    | 10/05/2024       | USD     | 1.850.000              | Citibank, New York                  | (65.901)   |
| RSD   | 89.871.550       | 13/05/2024       | USD     | 833.731                | Standard Chartered Bank, London     | (4.877)  |
| RON   | 574.558          | 16/05/2024       | USD     | 125.000                | Citibank, New York                  | (223)  |
| RON   | 1.788.940        | 16/05/2024       | USD     | 390.000                | BNP Paribas                         | (1.496)  |
| USD   | 25.000           | 16/05/2024       | RON     | 115.768                | Citibank, New York                  | (141)  |
| USD   | 445.000          | 16/05/2024       | RON     | 2.056.484              | Citibank, New York                  | (1.606)  |
| RON   | 965.775          | 16/05/2024       | USD     | 210.000                | Merrill Lynch International Bank    | (263)  |
| RON   | 459.269          | 16/05/2024       | USD     | 100.000                | Merrill Lynch International Bank    | (261)  |
| RON   | 455.000          | 16/05/2024       | USD     | 99.139                 | Merrill Lynch International Bank    | (327)  |
| RON   | 229.041          | 16/05/2024       | USD     | 50.000                 | Merrill Lynch International Bank    | (259)  |
| RON   | 227.690          | 16/05/2024       | USD     | 50.000                 | UBS, London                         | (553)  |
| RON   | 2.680.722        | 16/05/2024       | USD     | 585.000                | Merrill Lynch International Bank    | (2.828)  |

# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

| Teilfonds   | Im Austausch für | Erfüllungstermin | Währung | Kontrakt zur Lieferung | Kontrahent                          | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|---|------------------|------------------|---------|------------------------|-------------------------------------|--|
| <b>Global Emerging Markets ESG Local Debt (Fortsetzung)</b> |                  |                  |         |                        |                                     |  |
| USD   | 2.051.833        | 22/05/2024       | PEN     | 7.896.275              | Crédit Agricole                     | (68.381)   |
| USD   | 100.000          | 22/05/2024       | PEN     | 372.860                | BNP Paribas                         | (116)  |
| PEN   | 685.018          | 22/05/2024       | USD     | 185.000                | Standard Chartered Bank, London     | (1.067)  |
| USD   | 100.000          | 23/05/2024       | CZK     | 2.345.512              | Crédit Agricole                     | (169)  |
| USD   | 50.000           | 23/05/2024       | CZK     | 1.172.549              | Goldman Sachs International, London | (76)   |
| CZK   | 11.473.179       | 23/05/2024       | USD     | 490.000                | Morgan Stanley, London              | (17)   |
| CZK   | 4.682.658        | 23/05/2024       | USD     | 200.000                | UBS, London                         | (19)   |
| CZK   | 1.737.506        | 23/05/2024       | USD     | 75.000                 | UBS, London                         | (797)  |
| CZK   | 6.500.000        | 23/05/2024       | USD     | 279.693                | UBS, London                         | (2.098)  |
| TWD   | 1.589.475        | 24/05/2024       | USD     | 50.000                 | Crédit Agricole                     | (194)  |
| TWD   | 88.628.400       | 24/05/2024       | USD     | 2.800.000              | BNP Paribas                         | (22.834)   |
| TWD   | 94.009.600       | 24/05/2024       | USD     | 2.960.000              | J.P. Morgan Chase Bank, New York    | (14.214)   |
| USD   | 322.538          | 07/06/2024       | COP     | 1.313.189.076          | Morgan Stanley, London              | (13.539)   |
| USD   | 50.000           | 07/06/2024       | COP     | 201.867.500            | Crédit Agricole                     | (1.663)  |
| USD   | 50.000           | 07/06/2024       | COP     | 201.804.500            | Merrill Lynch International Bank    | (1.647)  |
| USD   | 50.000           | 07/06/2024       | COP     | 200.090.500            | Merrill Lynch International Bank    | (1.208)  |
| USD   | 50.000           | 07/06/2024       | COP     | 199.597.500            | Crédit Agricole                     | (1.082)  |
| USD   | 50.000           | 07/06/2024       | COP     | 196.954.000            | Merrill Lynch International Bank    | (405)  |
| USD   | 75.000           | 07/06/2024       | COP     | 294.749.250            | Crédit Agricole                     | (434)  |
| USD   | 100.000          | 07/06/2024       | COP     | 393.865.000            | Barclays Bank, London               | (800)  |
| USD   | 100.000          | 07/06/2024       | COP     | 394.332.000            | Crédit Agricole                     | (919)  |
| USD   | 9.223.176        | 11/06/2024       | MXN     | 160.845.268            | Morgan Stanley, London              | (348.286)  |
| USD   | 75.000           | 11/06/2024       | MXN     | 1.306.700              | Goldman Sachs International, London | (2.758)  |
| USD   | 100.000          | 11/06/2024       | MXN     | 1.733.839              | Merrill Lynch International Bank    | (3.176)  |
| USD   | 360.000          | 11/06/2024       | MXN     | 6.238.662              | Citibank, New York                  | (11.246)   |
| USD   | 344.145          | 11/06/2024       | MXN     | 5.945.000              | Goldman Sachs International, London | (9.625)  |
| USD   | 459.951          | 11/06/2024       | MXN     | 7.920.000              | Citibank, New York                  | (11.346)   |
| USD   | 150.000          | 11/06/2024       | MXN     | 2.566.530              | Merrill Lynch International Bank    | (2.727)  |
| USD   | 252.525          | 11/06/2024       | EGP     | 13.000.000             | J.P. Morgan Chase Bank, New York    | (17.081)   |
| USD   | 1.017.691        | 11/06/2024       | MXN     | 17.360.000             | UBS, London                         | (15.355)   |
| USD   | 200.000          | 11/06/2024       | MXN     | 3.381.629              | BNP Paribas                         | (1.231)  |
| USD   | 200.000          | 11/06/2024       | MXN     | 3.406.329              | Citibank, New York                  | (2.701)  |
| USD   | 3.940.000        | 11/06/2024       | MXN     | 67.507.527             | Citibank, New York                  | (77.187)   |
| USD   | 200.000          | 11/06/2024       | MXN     | 3.397.853              | UBS, London                         | (2.196)  |
| USD   | 150.000          | 11/06/2024       | MXN     | 2.540.030              | BNP Paribas                         | (1.150)  |
| USD   | 75.000           | 11/06/2024       | MXN     | 1.268.503              | Deutsche Bank, London               | (485)  |
| MXN   | 5.773.000        | 11/06/2024       | USD     | 345.173                | Morgan Stanley, London              | (1.638)  |
| IDR   | 2.347.950.000    | 12/06/2024       | USD     | 150.000                | J.P. Morgan Chase Bank, New York    | (2.398)  |
| IDR   | 3.935.250.000    | 12/06/2024       | USD     | 250.000                | J.P. Morgan Chase Bank, New York    | (2.614)  |
| IDR   | 6.211.160.000    | 12/06/2024       | USD     | 400.000                | Morgan Stanley, London              | (9.540)  |
| IDR   | 2.724.837.500    | 12/06/2024       | USD     | 175.000                | Morgan Stanley, London              | (3.705)  |
| USD   | 75.000           | 12/06/2024       | IDR     | 1.194.832.500          | Merrill Lynch International Bank    | (112)  |
| CNY   | 91.666.709       | 14/06/2024       | USD     | 12.913.896             | BNP Paribas                         | (99.292)   |
| CNY   | 1.065.405        | 14/06/2024       | USD     | 150.000                | Barclays Bank, London               | (1.061)  |

# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

| Teilfonds   | Im Austausch für | Erfüllungstermin | Währung | Kontrakt zur Lieferung | Kontrahent                          | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|---|------------------|------------------|---------|------------------------|-------------------------------------|--|
| <b>Global Emerging Markets ESG Local Debt (Fortsetzung)</b> |                  |                  |         |                        |                                     |  |
| CNY   | 1.419.461        | 14/06/2024       | USD     | 200.000                | Goldman Sachs International, London | (1.566)  |
| CNY   | 530.960          | 14/06/2024       | USD     | 75.000                 | BNP Paribas                         | (774)  |
| EUR   | 2.661.988        | 18/06/2024       | USD     | 2.890.147              | Merrill Lynch International Bank    | (6.173)  |
| EUR   | 22.806           | 18/06/2024       | USD     | 25.000                 | Merrill Lynch International Bank    | (292)  |
| MYR   | 14.413.737       | 25/06/2024       | USD     | 3.098.662              | Morgan Stanley, London              | (67.488)   |
| MYR   | 465.810          | 25/06/2024       | USD     | 100.000                | Crédit Agricole                     | (2.041)  |
| MYR   | 1.174.050        | 25/06/2024       | USD     | 250.000                | Crédit Agricole                     | (3.100)  |
| MYR   | 1.066.685        | 25/06/2024       | USD     | 225.000                | Morgan Stanley, London              | (679)  |
| ZAR   | 942.679          | 09/07/2024       | USD     | 50.000                 | Merrill Lynch International Bank    | (621)  |
| ZAR   | 4.200.000        | 09/07/2024       | USD     | 221.515                | UBS, London                         | (1.510)  |
| USD   | 150.000          | 09/07/2024       | ZAR     | 2.872.965              | Merrill Lynch International Bank    | (492)  |
| ZAR   | 4.600.000        | 09/07/2024       | USD     | 242.212                | BNP Paribas                         | (1.253)  |
| USD   | 150.000          | 09/07/2024       | ZAR     | 2.873.567              | Deutsche Bank, London               | (524)  |
| PLN   | 2.825.000        | 15/07/2024       | USD     | 709.615                | Barclays Bank, London               | (2.075)  |
| THB   | 456.436.547      | 17/07/2024       | USD     | 12.707.738             | Standard Chartered Bank, London     | (86.791)   |
| USD   | 75.000           | 17/07/2024       | THB     | 2.713.553              | Standard Chartered Bank, London     | (33)   |
| HUF   | 1.713.243.847    | 18/07/2024       | USD     | 4.674.160              | Merrill Lynch International Bank    | (4.766)  |
| USD   | 4.945.079        | 24/07/2024       | CLP     | 4.881.393.523          | Goldman Sachs International, London | (19.410)   |
| USD   | 25.000           | 24/07/2024       | CLP     | 24.629.500             | J.P. Morgan Chase Bank, New York    | (49)   |
| <b>USD</b>  |                  |                  |         |                        |                                     | <b>(2.403.431)</b>   |
| <b>Global Emerging Markets Local Debt</b>                   |                  |                  |         |                        |                                     |  |
| USD   | 28.891.746       | 02/04/2024       | BRL     | 143.800.000            | BNP Paribas                         | 163.636  |
| USD   | 1.561.083        | 02/04/2024       | BRL     | 7.800.000              | Barclays Bank, London               | 2.813  |
| USD   | 540.944          | 02/04/2024       | BRL     | 2.700.000              | Citibank, New York                  | 1.543  |
| USD   | 25.897.189       | 02/04/2024       | BRL     | 129.170.000            | Citibank, New York                  | 91.834   |
| EGP   | 144.150.000      | 02/04/2024       | USD     | 3.000.000              | Merrill Lynch International Bank    | 40.487   |
| EGP   | 23.324.000       | 02/04/2024       | USD     | 490.000                | J.P. Morgan Chase Bank, New York    | 1.962  |
| USD   | 295.000          | 05/04/2024       | MYR     | 1.391.214              | Morgan Stanley, London              | 1.342  |
| MYR   | 1.670.655        | 05/04/2024       | USD     | 350.000                | Barclays Bank, London               | 2.644  |
| MYR   | 714.290          | 05/04/2024       | USD     | 150.000                | Morgan Stanley, London              | 773  |
| USD   | 700.000          | 05/04/2024       | MYR     | 3.315.229              | Goldman Sachs International, London | 218  |
| USD   | 930.000          | 05/04/2024       | MYR     | 4.402.629              | Morgan Stanley, London              | 688  |
| USD   | 21.600.063       | 05/04/2024       | MYR     | 100.915.493            | Morgan Stanley, London              | 298.712  |
| USD   | 1.343.000        | 17/04/2024       | EGP     | 52.847.050             | Standard Chartered Bank, London     | 231.894  |
| USD   | 1.305.041        | 17/04/2024       | EGP     | 51.353.375             | Standard Chartered Bank, London     | 225.340  |
| USD   | 650.000          | 24/04/2024       | THB     | 23.263.630             | Standard Chartered Bank, London     | 11.286   |
| USD   | 500.000          | 24/04/2024       | THB     | 17.896.250             | Standard Chartered Bank, London     | 8.650  |
| USD   | 44.589.389       | 24/04/2024       | THB     | 1.610.345.800          | Standard Chartered Bank, London     | 376.548  |
| PLN   | 3.310.923        | 25/04/2024       | USD     | 830.000                | Merrill Lynch International Bank    | 106  |
| PLN   | 1.597.684        | 25/04/2024       | USD     | 400.000                | Morgan Stanley, London              | 567  |
| PLN   | 2.157.443        | 25/04/2024       | USD     | 540.000                | Goldman Sachs International, London | 908  |
| USD   | 19.967.775       | 25/04/2024       | PLN     | 79.428.576             | Barclays Bank, London               | 53.652   |
| USD   | 250.000          | 26/04/2024       | HUF     | 91.247.175             | Barclays Bank, London               | 306  |
| USD   | 437.739          | 26/04/2024       | HUF     | 159.460.000            | Barclays Bank, London               | 1.384  |
| USD   | 16.751.926       | 26/04/2024       | HUF     | 6.116.923.947          | Merrill Lynch International Bank    | 13.245   |
| USD   | 10.896           | 30.04.2024       | EUR     | 10.040                 | HSBC Bank PLC                       | 41   |



# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

| Teilfonds   | Im Austausch für | Erfüllungstermin | Währung | Kontrakt zur Lieferung | Kontrahent                          | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|---|------------------|------------------|---------|------------------------|-------------------------------------|--|
| <b>Global Emerging Markets Local Debt (Fortsetzung)</b> |                  |                  |         |                        |                                     |  |
| USD   | 690.000          | 03/05/2024       | BRL     | 3.448.392              | Goldman Sachs International, London | 3.201  |
| USD   | 2.820.152        | 03/05/2024       | BRL     | 14.006.002             | Citibank, New York                  | 30.647   |
| USD   | 600.000          | 03/05/2024       | BRL     | 2.988.125              | UBS, London                         | 4.870  |
| USD   | 5.600.000        | 03/05/2024       | BRL     | 28.008.400             | Citibank, New York                  | 21.709   |
| USD   | 10.745.266       | 03/05/2024       | BRL     | 53.743.844             | Barclays Bank, London               | 41.376   |
| USD   | 4.790.000        | 10/05/2024       | CLP     | 4.696.116.000          | Merrill Lynch International Bank    | 7.707  |
| USD   | 4.610.000        | 10/05/2024       | CLP     | 4.499.360.000          | Merrill Lynch International Bank    | 28.074   |
| CLP   | 49.218.000       | 10/05/2024       | USD     | 50.000                 | Citibank, New York                  | 121  |
| USD   | 4.660.000        | 10/05/2024       | CLP     | 4.546.808.600          | Standard Chartered Bank, London     | 29.754   |
| USD   | 5.170.000        | 10/05/2024       | CLP     | 5.061.430.000          | Standard Chartered Bank, London     | 15.689   |
| CLP   | 7.989.456.578    | 10/05/2024       | USD     | 8.103.954              | Goldman Sachs International, London | 32.114   |
| RSD   | 45.554.922       | 13/05/2024       | USD     | 420.000                | BNP Paribas                         | 137  |
| INR   | 3.448.219.733    | 14/05/2024       | USD     | 41.233.626             | Standard Chartered Bank, London     | 71.322   |
| USD   | 450.000          | 14/05/2024       | INR     | 37.385.100             | Deutsche Bank, London               | 2.178  |
| RON   | 460.631          | 16/05/2024       | USD     | 100.000                | Merrill Lynch International Bank    | 35   |
| USD   | 250.000          | 16/05/2024       | RON     | 1.148.172              | Merrill Lynch International Bank    | 652  |
| USD   | 750.000          | 16/05/2024       | RON     | 3.423.258              | Merrill Lynch International Bank    | 6.572  |
| USD   | 450.000          | 20/05/2024       | KRW     | 597.816.000            | Standard Chartered Bank, London     | 5.753  |
| ILS   | 24.073.843       | 21/05/2024       | USD     | 6.559.246              | Citibank, New York                  | 25.120   |
| USD   | 50.000           | 21/05/2024       | ILS     | 177.834                | Merrill Lynch International Bank    | 1.361  |
| PEN   | 283.853          | 22/05/2024       | USD     | 75.000                 | J.P. Morgan Chase Bank, New York    | 1.217  |
| PEN   | 378.430          | 22/05/2024       | USD     | 100.000                | Standard Chartered Bank, London     | 1.612  |
| USD   | 600.000          | 22/05/2024       | PEN     | 2.213.220              | Merrill Lynch International Bank    | 5.732  |
| CZK   | 3.517.647        | 23/05/2024       | USD     | 150.000                | Goldman Sachs International, London | 227  |
| USD   | 600.000          | 23/05/2024       | CZK     | 14.047.974             | UBS, London                         | 56   |
| USD   | 200.000          | 24/05/2024       | TWD     | 6.281.024              | UBS, London                         | 3.184  |
| EGP   | 118.070.750      | 28/05/2024       | USD     | 2.345.000              | J.P. Morgan Chase Bank, New York    | 112.866  |
| USD   | 2.615.078        | 28/05/2024       | EGP     | 118.070.750            | J.P. Morgan Chase Bank, New York    | 157.211  |
| COP   | 13.861.845.038   | 07/06/2024       | USD     | 3.404.671              | Morgan Stanley, London              | 142.915  |
| COP   | 995.810.000      | 07/06/2024       | USD     | 250.000                | Goldman Sachs International, London | 4.852  |
| COP   | 400.545.000      | 07/06/2024       | USD     | 100.000                | BNP Paribas                         | 2.509  |
| COP   | 396.912.000      | 07/06/2024       | USD     | 100.000                | Goldman Sachs International, London | 1.580  |
| COP   | 197.717.575      | 07/06/2024       | USD     | 50.000                 | BNP Paribas                         | 601  |
| MXN   | 328.205.860      | 11/06/2024       | USD     | 18.370.000             | Citibank, New York                  | 1.160.633  |
| MXN   | 866.919          | 11/06/2024       | USD     | 50.000                 | Merrill Lynch International Bank    | 1.588  |
| MXN   | 4.277.551        | 11/06/2024       | USD     | 250.000                | Merrill Lynch International Bank    | 4.545  |
| MXN   | 2.555.321        | 11/06/2024       | USD     | 150.000                | Merrill Lynch International Bank    | 2.060  |
| MXN   | 7.607.846        | 11/06/2024       | USD     | 450.000                | Goldman Sachs International, London | 2.722  |
| MXN   | 362.232.060      | 11/06/2024       | USD     | 21.222.484             | Morgan Stanley, London              | 332.956  |
| USD   | 780.000          | 12/06/2024       | IDR     | 12.280.866.000         | BNP Paribas                         | 7.973  |
| USD   | 700.000          | 12/06/2024       | IDR     | 11.018.700.000         | J.P. Morgan Chase Bank, New York    | 7.318  |

# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

| Teilfonds   | Im Austausch für | Erfüllungstermin | Währung | Kontrakt zur Lieferung | Kontrahent                          | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|---|------------------|------------------|---------|------------------------|-------------------------------------|--|
| <b>Global Emerging Markets Local Debt (Fortsetzung)</b> |                  |                  |         |                        |                                     |  |
| USD   | 290.000          | 14/06/2024       | CNY     | 2.058.304              | Barclays Bank, London               | 2.258  |
| USD   | 500.000          | 14/06/2024       | CNY     | 3.551.350              | Barclays Bank, London               | 3.537  |
| USD   | 18.650.000       | 14/06/2024       | CNY     | 133.291.550            | BNP Paribas                         | 16.425   |
| USD   | 100.000          | 18/06/2024       | EUR     | 91.899                 | Standard Chartered Bank, London     | 438  |
| USD   | 20.507.906       | 02/07/2024       | BRL     | 102.300.000            | Barclays Bank, London               | 245.265  |
| USD   | 1.396.787        | 02/07/2024       | BRL     | 7.000.000              | Morgan Stanley, London              | 10.292   |
| TRY   | 461.540.369      | 05/07/2024       | USD     | 12.550.000             | Standard Chartered Bank, London     | 225.086  |
| TRY   | 5.869.239        | 05/07/2024       | USD     | 159.064                | BNP Paribas                         | 3.392  |
| USD   | 185.894          | 09/07/2024       | ZAR     | 3.500.000              | Deutsche Bank, London               | 2.557  |
| PHP   | 478.541.441      | 23/07/2024       | USD     | 8.495.020              | Standard Chartered Bank, London     | 9.492  |
| USD   | 1.453.802        | 02/10/2024       | BRL     | 7.400.000              | Morgan Stanley, London              | 885  |
| USD   | 29.469.896       | 02/10/2024       | BRL     | 150.000.000            | Goldman Sachs International, London | 18.863   |
| EGP   | 125.810.400      | 24/03/2025       | USD     | 2.280.000              | Standard Chartered Bank, London     | 73.997   |
|   |                  |                  |         |                        | USD                                 | 4.425.815  |
| USD   | 3.281.956        | 02/04/2024       | BRL     | 16.630.000             | Morgan Stanley, London              | (40.356)   |
| EGP   | 77.847.000       | 02/04/2024       | USD     | 2.100.000              | BNP Paribas                         | (458.010)  |
| EGP   | 3.850.000        | 02/04/2024       | USD     | 100.000                | Standard Chartered Bank, London     | (18.794)   |
| BRL   | 150.000.000      | 02/04/2024       | USD     | 30.017.170             | Goldman Sachs International, London | (50.433)   |
| BRL   | 150.100.000      | 02/04/2024       | USD     | 30.136.629             | J.P. Morgan Chase Bank, New York    | (149.914)  |
| MYR   | 104.411.053      | 05/04/2024       | USD     | 22.443.854             | Barclays Bank, London               | (404.657)  |
| MYR   | 3.228.569        | 05/04/2024       | USD     | 710.000                | Morgan Stanley, London              | (28.510)   |
| EGP   | 179.876.225      | 17/04/2024       | USD     | 4.633.000              | Standard Chartered Bank, London     | (851.115)  |
| USD   | 1.470.000        | 17/04/2024       | EGP     | 75.264.000             | Standard Chartered Bank, London     | (112.420)  |
| THB   | 1.542.921.567    | 24/04/2024       | USD     | 45.160.883             | Standard Chartered Bank, London     | (2.799.207)  |
| THB   | 17.363.000       | 24/04/2024       | USD     | 500.000                | Standard Chartered Bank, London     | (23.289)   |
| THB   | 37.624.838       | 24/04/2024       | USD     | 1.070.000              | Standard Chartered Bank, London     | (36.991)   |
| THB   | 25.103.750       | 24/04/2024       | USD     | 700.000                | Standard Chartered Bank, London     | (10.764)   |
| THB   | 10.732.200       | 24/04/2024       | USD     | 300.000                | Standard Chartered Bank, London     | (5.342)  |
| THB   | 8.825.275        | 24/04/2024       | USD     | 250.000                | Standard Chartered Bank, London     | (7.698)  |
| THB   | 8.935.050        | 24/04/2024       | USD     | 250.000                | Standard Chartered Bank, London     | (4.684)  |
| PLN   | 70.307.596       | 25/04/2024       | USD     | 17.677.800             | Barclays Bank, London               | (50.463)   |
| PLN   | 795.804          | 25/04/2024       | USD     | 200.000                | Barclays Bank, London               | (478)  |
| PLN   | 99.296           | 25/04/2024       | USD     | 25.000                 | Morgan Stanley, London              | (105)  |
| USD   | 650.000          | 25/04/2024       | PLN     | 2.592.665              | Morgan Stanley, London              | (26)   |
| PLN   | 1.588.431        | 25/04/2024       | USD     | 400.000                | UBS, London                         | (1.753)  |
| PLN   | 789.247          | 25/04/2024       | USD     | 200.000                | BNP Paribas                         | (2.122)  |
| PLN   | 980.709          | 25/04/2024       | USD     | 250.000                | Deutsche Bank, London               | (4.119)  |
| PLN   | 394.107          | 25/04/2024       | USD     | 100.000                | UBS, London                         | (1.191)  |
| HUF   | 6.095.101.347    | 26/04/2024       | USD     | 17.452.337             | BNP Paribas                         | (773.373)  |
| HUF   | 90.143.525       | 26/04/2024       | USD     | 250.000                | Merrill Lynch International Bank    | (3.326)  |

# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

| Teilfonds   | Im Austausch für | Erfüllungstermin | Währung | Kontrakt zur Lieferung | Kontrahent                          | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|---|------------------|------------------|---------|------------------------|-------------------------------------|--|
| <b>Global Emerging Markets Local Debt (Fortsetzung)</b> |                  |                  |         |                        |                                     |  |
| HUF   | 182.386.250      | 26/04/2024       | USD     | 500.000                | UBS, London                         | (908)  |
| EUR   | 307.148          | 30.04.2024       | USD     | 335.705                | HSBC Bank PLC                       | (3.599)  |
| EUR   | 123.193          | 30.04.2024       | USD     | 134.647                | HSBC Bank PLC                       | (1.444)  |
| EUR   | 142.909.732      | 30.04.2024       | USD     | 156.196.621            | HSBC Bank PLC                       | (1.674.573)  |
| BRL   | 99.312.036       | 03/05/2024       | USD     | 19.941.815             | Goldman Sachs International, London | (162.340)  |
| USD   | 4.680.000        | 03/05/2024       | BRL     | 23.584.860             | Barclays Bank, London               | (17.277)   |
| BRL   | 1.492.302        | 03/05/2024       | USD     | 300.000                | Citibank, New York                  | (2.786)  |
| BRL   | 995.814          | 03/05/2024       | USD     | 200.000                | Deutsche Bank, London               | (1.669)  |
| BRL   | 22.980.424       | 03/05/2024       | USD     | 4.605.000              | BNP Paribas                         | (28.105)   |
| BRL   | 499.013          | 03/05/2024       | USD     | 100.000                | UBS, London                         | (614)  |
| BRL   | 500.035          | 03/05/2024       | USD     | 100.000                | Deutsche Bank, London               | (411)  |
| PHP   | 475.742.811      | 09/05/2024       | USD     | 8.528.868              | UBS, London                         | (69.032)   |
| PHP   | 2.798.630        | 09/05/2024       | USD     | 50.000                 | UBS, London                         | (234)  |
| USD   | 8.500.452        | 09/05/2024       | PHP     | 478.541.441            | Standard Chartered Bank, London     | (9.150)  |
| CLP   | 4.940.036.522    | 10/05/2024       | USD     | 5.417.129              | BNP Paribas                         | (386.439)  |
| CLP   | 48.407.500       | 10/05/2024       | USD     | 50.000                 | Merrill Lynch International Bank    | (704)  |
| CLP   | 5.729.350.000    | 10/05/2024       | USD     | 6.050.000              | Citibank, New York                  | (215.513)  |
| CLP   | 47.246.000       | 10/05/2024       | USD     | 50.000                 | Merrill Lynch International Bank    | (1.887)  |
| RSD   | 153.200.695      | 13/05/2024       | USD     | 1.421.231              | Standard Chartered Bank, London     | (8.312)  |
| INR   | 49.920.600       | 14/05/2024       | USD     | 600.000                | Morgan Stanley, London              | (2.020)  |
| INR   | 6.236.820        | 14/05/2024       | USD     | 75.000                 | Merrill Lynch International Bank    | (291)  |
| INR   | 6.230.580        | 14/05/2024       | USD     | 75.000                 | Crédit Agricole                     | (366)  |
| RON   | 20.410.581       | 16/05/2024       | USD     | 4.443.610              | BNP Paribas                         | (11.051)   |
| RON   | 2.752.216        | 16/05/2024       | USD     | 600.000                | BNP Paribas                         | (2.302)  |
| RON   | 458.082          | 16/05/2024       | USD     | 100.000                | Merrill Lynch International Bank    | (519)  |
| RON   | 912.485          | 16/05/2024       | USD     | 200.000                | Standard Chartered Bank, London     | (1.836)  |
| RON   | 910.184          | 16/05/2024       | USD     | 200.000                | Merrill Lynch International Bank    | (2.336)  |
| RON   | 342.735          | 16/05/2024       | USD     | 75.000                 | Merrill Lynch International Bank    | (568)  |
| KRW   | 61.408.624.398   | 20/05/2024       | USD     | 46.145.182             | BNP Paribas                         | (511.401)  |
| KRW   | 563.911.250      | 20/05/2024       | USD     | 425.000                | BNP Paribas                         | (5.948)  |
| KRW   | 132.669.000      | 20/05/2024       | USD     | 100.000                | Merrill Lynch International Bank    | (1.411)  |
| KRW   | 65.964.005       | 20/05/2024       | USD     | 50.000                 | UBS, London                         | (981)  |
| USD   | 1.781.865        | 22/05/2024       | PEN     | 6.857.331              | Crédit Agricole                     | (59.384)   |
| USD   | 150.000          | 22/05/2024       | PEN     | 565.268                | Morgan Stanley, London              | (1.779)  |
| CZK   | 571.028.805      | 23/05/2024       | USD     | 24.606.947             | Morgan Stanley, London              | (220.141)  |
| CZK   | 2.338.425        | 23/05/2024       | USD     | 100.000                | UBS, London                         | (133)  |
| CZK   | 15.687.816       | 23/05/2024       | USD     | 670.000                | Morgan Stanley, London              | (24)   |
| CZK   | 4.631.522        | 23/05/2024       | USD     | 200.000                | UBS, London                         | (2.203)  |
| CZK   | 2.892.985        | 23/05/2024       | USD     | 125.000                | UBS, London                         | (1.450)  |
| TWD   | 486.170.656      | 24/05/2024       | USD     | 15.641.047             | Crédit Agricole                     | (406.915)  |
| TWD   | 285.826.590      | 24/05/2024       | USD     | 9.030.000              | BNP Paribas                         | (73.639)   |
| TWD   | 300.449.600      | 24/05/2024       | USD     | 9.460.000              | J.P. Morgan Chase Bank, New York    | (45.428)   |
| USD   | 250.000          | 07/06/2024       | COP     | 1.000.280.000          | Merrill Lynch International Bank    | (5.996)  |
| USD   | 484.135          | 11/06/2024       | MXN     | 8.442.942              | Morgan Stanley, London              | (18.282)   |
| USD   | 770.000          | 11/06/2024       | MXN     | 13.343.805             | Citibank, New York                  | (24.053)   |
| USD   | 900.000          | 11/06/2024       | MXN     | 15.542.239             | Standard Chartered Bank, London     | (24.876)   |
| USD   | 2.260.627        | 11/06/2024       | MXN     | 38.820.000             | Goldman Sachs International, London | (49.445)   |
| USD   | 734.786          | 11/06/2024       | MXN     | 12.590.000             | UBS, London                         | (14.411)   |

# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

| Teilfonds   | Im Austausch für | Erfüllungstermin | Währung | Kontrakt zur Lieferung | Kontrahent                          | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|---|------------------|------------------|---------|------------------------|-------------------------------------|--|
| <b>Global Emerging Markets Local Debt (Fortsetzung)</b> |                  |                  |         |                        |                                     |  |
| USD   | 1.586.261        | 11/06/2024       | MXN     | 27.030.000             | Morgan Stanley, London              | (22.220)   |
| USD   | 12.780.000       | 11/06/2024       | MXN     | 218.971.114            | Citibank, New York                  | (250.372)  |
| IDR   | 502.763.523.159  | 12/06/2024       | USD     | 32.216.247             | BNP Paribas                         | (610.414)  |
| IDR   | 12.552.720.000   | 12/06/2024       | USD     | 800.000                | Morgan Stanley, London              | (10.883)   |
| IDR   | 3.925.125.000    | 12/06/2024       | USD     | 250.000                | BNP Paribas                         | (3.250)  |
| IDR   | 3.156.600.000    | 12/06/2024       | USD     | 200.000                | Goldman Sachs International, London | (1.563)  |
| IDR   | 6.212.880.000    | 12/06/2024       | USD     | 400.000                | Merrill Lynch International Bank    | (9.432)  |
| IDR   | 3.128.780.000    | 12/06/2024       | USD     | 200.000                | Morgan Stanley, London              | (3.312)  |
| CNY   | 676.946.146      | 14/06/2024       | USD     | 95.367.362             | BNP Paribas                         | (733.257)  |
| CNY   | 2.131.178        | 14/06/2024       | USD     | 300.000                | Goldman Sachs International, London | (2.071)  |
| CNY   | 2.124.768        | 14/06/2024       | USD     | 300.000                | Goldman Sachs International, London | (2.967)  |
| CNY   | 708.790          | 14/06/2024       | USD     | 100.000                | Citibank, New York                  | (914)  |
| EUR   | 8.583.076        | 18/06/2024       | USD     | 9.318.731              | Merrill Lynch International Bank    | (19.905)   |
| EUR   | 91.186           | 18/06/2024       | USD     | 100.000                | Deutsche Bank, London               | (1.210)  |
| SGD   | 34.936.277       | 24/06/2024       | USD     | 26.131.855             | Standard Chartered Bank, London     | (148.304)  |
| SGD   | 133.168          | 24/06/2024       | USD     | 100.000                | Deutsche Bank, London               | (957)  |
| SGD   | 132.466          | 24/06/2024       | USD     | 100.000                | Standard Chartered Bank, London     | (1.480)  |
| SGD   | 99.744           | 24/06/2024       | USD     | 75.000                 | Morgan Stanley, London              | (816)  |
| MYR   | 100.915.493      | 25/06/2024       | USD     | 21.694.792             | Morgan Stanley, London              | (472.509)  |
| MYR   | 1.396.761        | 25/06/2024       | USD     | 300.000                | Morgan Stanley, London              | (6.265)  |
| MYR   | 1.631.910        | 25/06/2024       | USD     | 350.000                | Crédit Agricole                     | (6.813)  |
| TRY   | 334.134.200      | 05/07/2024       | USD     | 9.370.000              | UBS, London                         | (121.420)  |
| ZAR   | 154.758.358      | 09/07/2024       | USD     | 8.196.798              | Morgan Stanley, London              | (90.228)   |
| ZAR   | 1.884.368        | 09/07/2024       | USD     | 100.000                | Morgan Stanley, London              | (1.293)  |
| ZAR   | 945.691          | 09/07/2024       | USD     | 50.000                 | Merrill Lynch International Bank    | (463)  |
| PLN   | 79.428.576       | 15/07/2024       | USD     | 19.946.149             | Barclays Bank, London               | (52.718)   |
| THB   | 1.610.345.800    | 17/07/2024       | USD     | 44.833.950             | Standard Chartered Bank, London     | (306.207)  |
| HUF   | 6.116.923.947    | 18/07/2024       | USD     | 16.688.508             | Merrill Lynch International Bank    | (17.015)   |
| USD   | 8.093.692        | 24/07/2024       | CLP     | 7.989.456.578          | Goldman Sachs International, London | (31.769)   |
| BRL   | 53.743.844       | 02/08/2024       | USD     | 10.653.716             | Barclays Bank, London               | (40.153)   |
|   |                  |                  |         |                        | <b>USD</b>                          | <b>(12.883.506)</b>  |
| <b>Global ESG Corporate Bond</b>                        |                  |                  |         |                        |                                     |  |
| USD   | 40.862.851       | 04/04/2024       | EUR     | 37.800.000             | Société Générale, Paris             | 26.359   |
| USD   | 1.082.318        | 04/04/2024       | EUR     | 1.000.000              | UBS                                 | 1.988  |
| USD   | 17.418           | 30.04.2024       | EUR     | 16.013                 | HSBC Bank PLC                       | 101  |
| USD   | 5.032            | 30.04.2024       | EUR     | 4.645                  | HSBC Bank PLC                       | 8  |
| USD   | 3.513            | 30.04.2024       | GBP     | 2.773                  | HSBC Bank PLC                       | 10   |
| GBP   | 34.928           | 30.04.2024       | USD     | 44.022                 | HSBC Bank PLC                       | 106  |
| GBP   | 236.078          | 30.04.2024       | USD     | 297.882                | HSBC Bank PLC                       | 376  |
| GBP   | 83.842           | 30.04.2024       | USD     | 105.888                | HSBC Bank PLC                       | 37   |
| GBP   | 2.812            | 30.04.2024       | USD     | 3.552                  | HSBC Bank PLC                       | 1  |
| USD   | 17.558.197       | 30.04.2024       | GBP     | 13.863.000             | NatWest National Westminster Bank   | 43.820   |
| USD   | 36.639.590       | 15/05/2024       | EUR     | 33.400.000             | Société Générale, Paris             | 498.342  |
|   |                  |                  |         |                        | <b>USD</b>                          | <b>571.148</b>   |
| EUR   | 2.764.031        | 30.04.2024       | USD     | 3.021.014              | HSBC Bank PLC                       | (31.832)   |
| EUR   | 15.178           | 30.04.2024       | USD     | 16.443                 | HSBC Bank PLC                       | (28)   |

# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

| Teilfonds                                      | Im Austausch für | Erfüllungstermin | Währung | Kontrakt zur Lieferung | Kontrahent                          | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|--|------------------|------------------|---------|------------------------|-------------------------------------|--|
| <b>Global ESG Corporate Bond (Fortsetzung)</b> |                  |                  |         |                        |                                     |  |
| USD  | 25.055           | 30.04.2024       | EUR     | 23.228                 | HSBC Bank PLC                       | (65)   |
| GBP  | 41.587.522       | 30.04.2024       | USD     | 53.131.386             | HSBC Bank PLC                       | (590.126)  |
| GBP  | 114.217          | 30.04.2024       | USD     | 144.442                | HSBC Bank PLC                       | (142)  |
| USD  | 424.876          | 30.04.2024       | GBP     | 337.335                | HSBC Bank PLC                       | (1.310)  |
| <b>USD</b>                                     |                  |                  |         |                        |                                     | <b>(623.503)</b>   |
| <b>Global Government Bond</b>                  |                  |                  |         |                        |                                     |  |
| USD  | 160.946.984      | 10/04/2024       | CAD     | 217.600.000            | Merrill Lynch International Bank    | 130.049  |
| USD  | 12.354.269       | 10/04/2024       | CAD     | 16.600.000             | BNP Paribas                         | 86.065   |
| USD  | 3.178.234        | 10/04/2024       | AUD     | 4.800.000              | NatWest National Westminster Bank   | 46.087   |
| USD  | 14.917.874       | 10/04/2024       | CAD     | 20.100.000             | Crédit Agricole                     | 63.001   |
| USD  | 3.423.960        | 11/04/2024       | JPY     | 508.000.000            | UBS, London                         | 62.282   |
| USD  | 20.857.232       | 26/04/2024       | NZD     | 34.000.000             | NatWest National Westminster Bank   | 519.604  |
| USD  | 8.750.688        | 26/04/2024       | DKK     | 59.600.000             | HSBC, Sheffield                     | 111.224  |
| USD  | 2.788.092        | 26/04/2024       | SEK     | 29.000.000             | HSBC, Sheffield                     | 73.428   |
| USD  | 17.487.424       | 26/04/2024       | NZD     | 28.700.000             | Crédit Agricole                     | 320.073  |
| USD  | 8.043.016        | 26/04/2024       | PLN     | 32.030.000             | BNP Paribas                         | 12.609   |
| USD  | 4.702.400        | 26/04/2024       | SEK     | 48.000.000             | NatWest National Westminster Bank   | 209.165  |
| INR  | 2.960.000.000    | 30.04.2024       | USD     | 35.451.862             | BNP Paribas                         | 19.033   |
| IDR  | 280.000.000.000  | 30.04.2024       | USD     | 17.592.327             | UBS, London                         | 31.924   |
| USD  | 953.810          | 30.04.2024       | EUR     | 880.586                | HSBC Bank PLC                       | 1.671  |
| USD  | 103.830          | 30.04.2024       | GBP     | 81.954                 | HSBC Bank PLC                       | 286  |
| GBP  | 4.208.191        | 30.04.2024       | USD     | 5.309.892              | HSBC Bank PLC                       | 6.904  |
| GBP  | 269.853          | 30.04.2024       | USD     | 340.810                | HSBC Bank PLC                       | 133  |
| GBP  | 259.735          | 30.04.2024       | USD     | 328.063                | HSBC Bank PLC                       | 96   |
| GBP  | 831              | 30.04.2024       | USD     | 1.048                  | HSBC Bank PLC                       | 1  |
| USD  | 9.219.757        | 09/05/2024       | EUR     | 8.500.000              | Crédit Agricole                     | 25.931   |
| USD  | 4.895.075        | 09/05/2024       | EUR     | 4.500.000              | Crédit Agricole                     | 27.755   |
| USD  | 813.288          | 09/05/2024       | EUR     | 750.000                | NatWest National Westminster Bank   | 2.068  |
| USD  | 919.147.382      | 09/05/2024       | EUR     | 844.890.000            | Crédit Agricole                     | 5.291.888  |
| USD  | 10.933.680       | 09/05/2024       | EUR     | 10.000.000             | NatWest National Westminster Bank   | 117.414  |
| USD  | 4.557.230        | 09/05/2024       | EUR     | 4.160.000              | UBS, London                         | 57.663   |
| USD  | 18.422.813       | 09/05/2024       | EUR     | 16.800.000             | UBS, London                         | 251.486  |
| USD  | 32.549.724       | 09/05/2024       | EUR     | 29.700.000             | BNP Paribas                         | 425.414  |
| USD  | 4.386.846        | 09/05/2024       | EUR     | 4.000.000              | Merrill Lynch International Bank    | 60.339   |
| USD  | 11.292.922       | 09/05/2024       | EUR     | 10.350.000             | State Street Bank and Trust Company | 98.087   |
| USD  | 5.757.053        | 09/05/2024       | EUR     | 5.300.000              | State Street Bank and Trust Company | 24.433   |
| USD  | 13.000.267       | 10/05/2024       | GBP     | 10.250.000             | Crédit Agricole                     | 49.289   |
| USD  | 9.971.387        | 10/05/2024       | JPY     | 1.487.000.000          | NatWest National Westminster Bank   | 87.640   |
| USD  | 6.068.196        | 10/05/2024       | GBP     | 4.800.000              | Crédit Agricole                     | 3.349  |
| USD  | 4.117.800        | 10/05/2024       | JPY     | 610.000.000            | Merrill Lynch International Bank    | 63.270   |
| USD  | 21.106.275       | 10/05/2024       | JPY     | 3.146.000.000          | NatWest National Westminster Bank   | 195.537  |

# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

| Teilfonds                                   | Im Austausch für | Erfüllungstermin | Währung | Kontrakt zur Lieferung | Kontrahent                          | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|---|------------------|------------------|---------|------------------------|-------------------------------------|--|
| <b>Global Government Bond (Fortsetzung)</b> |                  |                  |         |                        |                                     |  |
| USD   | 201.758.248      | 10/05/2024       | GBP     | 158.500.000            | Crédit Agricole                     | 1.491.915  |
| USD   | 463.889.511      | 10/05/2024       | JPY     | 68.788.000.000         | Merrill Lynch International Bank    | 6.671.506  |
| USD   | 6.644.967        | 10/05/2024       | JPY     | 975.000.000            | UBS, London                         | 164.366  |
| USD   | 5.116.356        | 10/05/2024       | GBP     | 4.000.000              | UBS, London                         | 62.316   |
| USD   | 3.319.073        | 10/05/2024       | JPY     | 487.000.000            | UBS, London                         | 82.096   |
| USD   | 23.666.902       | 10/05/2024       | JPY     | 3.457.000.000          | J.P. Morgan Chase Bank, New York    | 689.019  |
| USD   | 20.226.672       | 10/05/2024       | GBP     | 15.800.000             | Crédit Agricole                     | 263.214  |
| USD   | 10.107.261       | 10/05/2024       | GBP     | 7.900.000              | Crédit Agricole                     | 125.532  |
| GBP   | 1.210.000        | 10/05/2024       | USD     | 1.527.130              | Merrill Lynch International Bank    | 1.718  |
|   |                  |                  |         |                        | USD                                 | 18.026.880   |
| USD   | 142.226.598      | 10/04/2024       | AUD     | 218.300.000            | UBS, London                         | (220.833)  |
| USD   | 9.132.238        | 10/04/2024       | AUD     | 14.000.000             | HSBC, Sheffield                     | (3.191)  |
| USD   | 12.226.467       | 10/04/2024       | AUD     | 18.800.000             | BNP Paribas                         | (41.108)   |
| USD   | 8.843.801        | 10/04/2024       | CAD     | 12.000.000             | HSBC, Sheffield                     | (24.780)   |
| USD   | 21.381.933       | 26/04/2024       | PLN     | 86.100.000             | NatWest National Westminster Bank   | (204.643)  |
| USD   | 19.482.662       | 26/04/2024       | MXN     | 340.000.000            | State Street Bank and Trust Company | (896.449)  |
| USD   | 10.477.750       | 26/04/2024       | MXN     | 180.000.000            | Merrill Lynch International Bank    | (311.191)  |
| PLN   | 118.130.000      | 26/04/2024       | USD     | 30.124.416             | Goldman Sachs International, London | (507.434)  |
| AUD   | 53.700.000       | 30.04.2024       | USD     | 35.523.731             | Merrill Lynch International Bank    | (462.781)  |
| JPY   | 10.500.000.000   | 30.04.2024       | USD     | 72.033.550             | Merrill Lynch International Bank    | (2.348.482)  |
| JPY   | 1.060.000.000    | 30.04.2024       | USD     | 7.133.536              | NatWest National Westminster Bank   | (98.663)   |
| AUD   | 5.300.000        | 30.04.2024       | USD     | 3.464.951              | BNP Paribas                         | (4.560)  |
| INR   | 260.000.000      | 30.04.2024       | USD     | 3.124.850              | Goldman Sachs International, London | (9.163)  |
| JPY   | 750.000.000      | 30.04.2024       | USD     | 5.106.703              | Citigroup Global Markets Limited    | (129.198)  |
| JPY   | 840.000.000      | 30.04.2024       | USD     | 5.742.962              | J.P. Morgan Chase Bank, New York    | (168.156)  |
| INR   | 470.000.000      | 30.04.2024       | USD     | 5.670.973              | J.P. Morgan Chase Bank, New York    | (38.770)   |
| IDR   | 70.000.000.000   | 30.04.2024       | USD     | 4.512.022              | HSBC, Sheffield                     | (105.959)  |
| AUD   | 8.500.000        | 30.04.2024       | USD     | 5.631.385              | BNP Paribas                         | (81.700)   |
| EUR   | 114.756          | 30.04.2024       | USD     | 125.425                | HSBC Bank PLC                       | (1.345)  |
| EUR   | 640              | 30.04.2024       | USD     | 694                    | HSBC Bank PLC                       | (1)  |
| EUR   | 316.601.557      | 30.04.2024       | USD     | 346.037.270            | HSBC Bank PLC                       | (3.709.841)  |
| EUR   | 415.242          | 30.04.2024       | USD     | 451.680                | HSBC Bank PLC                       | (2.696)  |
| EUR   | 1.778.933        | 30.04.2024       | USD     | 1.927.175              | HSBC Bank PLC                       | (3.693)  |
| EUR   | 160.627          | 30.04.2024       | USD     | 174.335                | HSBC Bank PLC                       | (656)  |
| EUR   | 247.585          | 30.04.2024       | USD     | 268.481                | HSBC Bank PLC                       | (778)  |
| EUR   | 177.790          | 30.04.2024       | USD     | 192.583                | HSBC Bank PLC                       | (346)  |
| USD   | 2.011.092        | 30.04.2024       | EUR     | 1.864.462              | HSBC Bank PLC                       | (4.869)  |
| EUR   | 23.917           | 30.04.2024       | USD     | 26.140                 | HSBC Bank PLC                       | (280)  |
| EUR   | 133              | 30.04.2024       | USD     | 144                    | HSBC Bank PLC                       | -  |
| GBP   | 725.690.341      | 30.04.2024       | USD     | 927.127.466            | HSBC Bank PLC                       | (10.261.608)   |
| USD   | 145.976          | 30.04.2024       | GBP     | 115.820                | HSBC Bank PLC                       | (356)  |
| GBP   | 64.603           | 30.04.2024       | USD     | 81.699                 | HSBC Bank PLC                       | (77)   |

# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

| Teilfonds                                   | Im Austausch für | Erfüllungstermin | Währung | Kontrakt zur Lieferung | Kontrahent                          | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|---|------------------|------------------|---------|------------------------|-------------------------------------|--|
| <b>Global Government Bond (Fortsetzung)</b> |                  |                  |         |                        |                                     |  |
| USD   | 5.228.833        | 30.04.2024       | GBP     | 4.151.495              | HSBC Bank PLC                       | (16.330)   |
| GBP   | 144.116          | 30.04.2024       | USD     | 184.120                | HSBC Bank PLC                       | (2.038)  |
| CHF   | 12.818.381       | 30.04.2024       | USD     | 14.386.042             | HSBC Bank PLC                       | (111.891)  |
| CHF   | 67.004           | 30.04.2024       | USD     | 74.927                 | HSBC Bank PLC                       | (313)  |
| USD   | 96.836           | 30.04.2024       | CHF     | 87.506                 | HSBC Bank PLC                       | (608)  |
| SGD   | 88.980.564       | 30.04.2024       | USD     | 66.570.329             | HSBC Bank PLC                       | (553.205)  |
| SGD   | 485.382          | 30.04.2024       | USD     | 361.037                | HSBC Bank PLC                       | (919)  |
| SGD   | 37.814           | 30.04.2024       | USD     | 28.135                 | HSBC Bank PLC                       | (80)   |
| SGD   | 522.047          | 30.04.2024       | USD     | 388.407                | HSBC Bank PLC                       | (1.086)  |
| SGD   | 67.851           | 30.04.2024       | USD     | 50.385                 | HSBC Bank PLC                       | (44)   |
| USD   | 390.277          | 30.04.2024       | SGD     | 526.668                | HSBC Bank PLC                       | (472)  |
| AUD   | 9.638.382        | 30.04.2024       | USD     | 6.376.725              | HSBC Bank PLC                       | (83.785)   |
| AUD   | 142.398          | 30.04.2024       | USD     | 93.633                 | HSBC Bank PLC                       | (660)  |
| AUD   | 54.956           | 30.04.2024       | USD     | 35.912                 | HSBC Bank PLC                       | (31)   |
| USD   | 37.627           | 30.04.2024       | AUD     | 57.951                 | HSBC Bank PLC                       | (210)  |
| EUR   | 33.900.000       | 09/05/2024       | USD     | 36.825.306             | BNP Paribas                         | (158.164)  |
| EUR   | 4.550.000        | 09/05/2024       | USD     | 4.931.548              | State Street Bank and Trust Company | (10.147)   |
| JPY   | 4.250.000.000    | 10/05/2024       | USD     | 28.701.631             | Crédit Agricole                     | (452.859)  |
| GBP   | 16.080.000       | 10/05/2024       | USD     | 20.384.922             | NatWest National Westminster Bank   | (67.681)   |
|   |                  |                  |         |                        | <b>USD</b>                          | <b>(21.104.130)</b>  |
| <b>Global Green Bond</b>                    |                  |                  |         |                        |                                     |  |
| USD   | 18.643.462       | 11/04/2024       | EUR     | 17.200.000             | Bank of America                     | 60.017   |
| USD   | 270.734          | 11/04/2024       | EUR     | 250.000                | Barclays Bank, London               | 626  |
| USD   | 25.519.395       | 18/04/2024       | EUR     | 23.450.000             | HSBC Bank PLC                       | 176.134  |
| USD   | 5.927            | 30.04.2024       | EUR     | 5.449                  | HSBC Bank PLC                       | 35   |
| USD   | 2.771            | 30.04.2024       | GBP     | 2.188                  | HSBC Bank PLC                       | 8  |
| GBP   | 9.966            | 30.04.2024       | USD     | 12.560                 | HSBC Bank PLC                       | 31   |
| GBP   | 88.512           | 30.04.2024       | USD     | 111.684                | HSBC Bank PLC                       | 145  |
| GBP   | 28.118           | 30.04.2024       | USD     | 35.511                 | HSBC Bank PLC                       | 14   |
| GBP   | 959              | 30.04.2024       | USD     | 1.211                  | HSBC Bank PLC                       | -  |
|   |                  |                  |         |                        | <b>USD</b>                          | <b>237.010</b>   |
| EUR   | 926.992          | 30.04.2024       | USD     | 1.013.178              | HSBC Bank PLC                       | (10.861)   |
| EUR   | 6.089            | 30.04.2024       | USD     | 6.596                  | HSBC Bank PLC                       | (13)   |
| USD   | 6.603            | 30.04.2024       | EUR     | 6.122                  | HSBC Bank PLC                       | (16)   |
| GBP   | 13.091.750       | 30.04.2024       | USD     | 16.725.758             | HSBC Bank PLC                       | (185.124)  |
| GBP   | 38.890           | 30.04.2024       | USD     | 49.181                 | HSBC Bank PLC                       | (46)   |
| USD   | 107.176          | 30.04.2024       | GBP     | 85.093                 | HSBC Bank PLC                       | (335)  |
|   |                  |                  |         |                        | <b>USD</b>                          | <b>(196.395)</b>   |

# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

| Teilfonds                      | Im Austausch für | Erfüllungstermin | Währung | Kontrakt zur Lieferung | Kontrahent                          | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|--------------------------------|------------------|------------------|---------|------------------------|-------------------------------------|--|
| <b>Global High Income Bond</b> |                  |                  |         |                        |                                     |  |
| USD                            | 98.222           | 03/04/2024       | GBP     | 77.668                 | UBS, London                         | 108  |
| USD                            | 8.024.711        | 03/04/2024       | EUR     | 7.399.295              | BNP Paribas                         | 32.832   |
| USD                            | 1.922.602        | 03/04/2024       | EUR     | 1.750.000              | Morgan Stanley, London              | 32.451   |
| USD                            | 1.086.822        | 03/04/2024       | EUR     | 1.000.000              | BNP Paribas                         | 6.736  |
| USD                            | 1.196.561        | 03/04/2024       | EUR     | 1.100.000              | Morgan Stanley, London              | 8.466  |
| USD                            | 108.372.240      | 26/04/2024       | EUR     | 100.000.000            | BNP Paribas                         | 263.957  |
| USD                            | 3.250.222        | 26/04/2024       | EUR     | 3.000.000              | Société Générale, Paris             | 6.974  |
| USD                            | 79               | 30.04.2024       | EUR     | 73                     | HSBC Bank PLC                       | -  |
| GBP                            | 6.423            | 30.04.2024       | USD     | 8.089                  | HSBC Bank PLC                       | 25   |
| USD                            | 162              | 30.04.2024       | SGD     | 218                    | HSBC Bank PLC                       | -  |
| USD                            | 136              | 30.04.2024       | SGD     | 183                    | HSBC Bank PLC                       | -  |
| USD                            | 82.958           | 30.04.2024       | SGD     | 111.775                | HSBC Bank PLC                       | 29   |
| USD                            | 565.797          | 30.04.2024       | SGD     | 760.430                | HSBC Bank PLC                       | 1.613  |
| USD                            | 98.439           | 30.04.2024       | CNH     | 709.160                | HSBC Bank PLC                       | 672  |
| USD                            | 54.770           | 30.04.2024       | AUD     | 83.295                 | HSBC Bank PLC                       | 386  |
| USD                            | 23.042           | 30.04.2024       | AUD     | 35.212                 | HSBC Bank PLC                       | 51   |
| USD                            | 16.139.497       | 30.04.2024       | EUR     | 14.900.000             | State Street Bank and Trust Company | 28.778   |
| USD                            | 3.724.479        | 30.04.2024       | AUD     | 5.700.000              | State Street Bank and Trust Company | 2.925  |
| BRL                            | 5.545.166        | 03/05/2024       | USD     | 1.100.000              | Barclays Bank, London               | 4.403  |
| USD                            | 343              | 03/05/2024       | BRL     | 1.716                  | Morgan Stanley, London              | 1  |
| USD                            | 525.000          | 10/05/2024       | CLP     | 514.998.750            | Barclays Bank, London               | 551  |
| USD                            | 108.955.450      | 24/05/2024       | EUR     | 100.000.000            | Crédit Agricole                     | 731.442  |
| USD                            | 922.269          | 18/06/2024       | EUR     | 849.462                | Merrill Lynch International Bank    | 1.970  |
| EGP                            | 31.929.000       | 24/03/2025       | USD     | 580.000                | J.P. Morgan Chase Bank, New York    | 17.413   |
| <b>USD</b>                     |                  |                  |         |                        |                                     | <b>1.141.783</b>   |
| USD                            | 5.405.103        | 26/04/2024       | EUR     | 5.000.000              | BNP Paribas                         | (311)  |
| EUR                            | 3.196.346        | 30.04.2024       | USD     | 3.493.523              | HSBC Bank PLC                       | (37.454)   |
| EUR                            | 82.261           | 30.04.2024       | USD     | 89.909                 | HSBC Bank PLC                       | (963)  |
| EUR                            | 29.891           | 30.04.2024       | USD     | 32.670                 | HSBC Bank PLC                       | (350)  |
| EUR                            | 3.802.212        | 30.04.2024       | USD     | 4.155.718              | HSBC Bank PLC                       | (44.554)   |
| EUR                            | 1.111            | 30.04.2024       | USD     | 1.204                  | HSBC Bank PLC                       | (2)  |
| EUR                            | 3.263            | 30.04.2024       | USD     | 3.542                  | HSBC Bank PLC                       | (13)   |
| EUR                            | 23.091           | 30.04.2024       | USD     | 25.040                 | HSBC Bank PLC                       | (73)   |
| EUR                            | 3.128            | 30.04.2024       | USD     | 3.388                  | HSBC Bank PLC                       | (6)  |
| EUR                            | 10.572.058       | 30.04.2024       | USD     | 11.554.985             | HSBC Bank PLC                       | (123.880)  |
| EUR                            | 1.436            | 30.04.2024       | USD     | 1.556                  | HSBC Bank PLC                       | (3)  |
| EUR                            | 59.106           | 30.04.2024       | USD     | 64.024                 | HSBC Bank PLC                       | (115)  |
| EUR                            | 8.269.720        | 30.04.2024       | USD     | 9.038.588              | HSBC Bank PLC                       | (96.902)   |
| GBP                            | 1.276.893        | 30.04.2024       | USD     | 1.631.333              | HSBC Bank PLC                       | (18.056)   |
| SGD                            | 3.219.799        | 30.04.2024       | USD     | 2.408.875              | HSBC Bank PLC                       | (20.018)   |



# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

| Teilfonds                                    | Im Austausch für | Erfüllungstermin | Währung | Kontrakt zur Lieferung | Kontrahent                       | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|--|------------------|------------------|---------|------------------------|----------------------------------|--|
| <b>Global High Income Bond (Fortsetzung)</b> |                  |                  |         |                        |                                  |  |
| SGD  | 6.249            | 30.04.2024       | USD     | 4.638                  | HSBC Bank PLC                    | (2)  |
| SGD  | 12               | 30.04.2024       | USD     | 9                      | HSBC Bank PLC                    | -  |
| SGD  | 30.468.006       | 30.04.2024       | USD     | 22.794.474             | HSBC Bank PLC                    | (189.424)  |
| SGD  | 78.972           | 30.04.2024       | USD     | 58.862                 | HSBC Bank PLC                    | (271)  |
| SGD  | 2.585            | 30.04.2024       | USD     | 1.923                  | HSBC Bank PLC                    | (5)  |
| SGD  | 5.354            | 30.04.2024       | USD     | 3.976                  | HSBC Bank PLC                    | (3)  |
| CNH  | 181.559.987      | 30.04.2024       | USD     | 25.246.298             | HSBC Bank PLC                    | (215.989)  |
| CNH  | 98.000           | 30.04.2024       | USD     | 13.545                 | HSBC Bank PLC                    | (35)   |
| CNH  | 108.920          | 30.04.2024       | USD     | 15.052                 | HSBC Bank PLC                    | (36)   |
| AUD  | 162.868.630      | 30.04.2024       | USD     | 107.753.397            | HSBC Bank PLC                    | (1.415.801)  |
| USD  | 407.800          | 30.04.2024       | AUD     | 624.847                | HSBC Bank PLC                    | (166)  |
| AUD  | 433.464          | 30.04.2024       | USD     | 283.584                | HSBC Bank PLC                    | (574)  |
| CAD  | 1.044.182        | 30.04.2024       | USD     | 774.674                | HSBC Bank PLC                    | (2.747)  |
| USD  | 7.822.366        | 30.04.2024       | GBP     | 6.200.000              | Citigroup Global Markets Limited | (10.959)   |
| USD  | 1.100.000        | 03/05/2024       | BRL     | 5.543.450              | Barclays Bank, London            | (4.061)  |
| USD  | 98.073           | 03/05/2024       | GBP     | 77.668                 | UBS, London                      | (56)   |
| USD  | 12.157.276       | 03/05/2024       | EUR     | 11.249.295             | BNP Paribas                      | (7.502)  |
| CLP  | 528.566.500      | 10/05/2024       | USD     | 550.000                | Morgan Stanley, London           | (11.734)   |
| USD  | 13.774           | 10/05/2024       | CLP     | 13.567.750             | Merrill Lynch International Bank | (43)   |
| IDR  | 8.676.250.000    | 12/06/2024       | USD     | 555.960                | BNP Paribas                      | (10.534)   |
| <b>USD</b>                                   |                  |                  |         |                        |                                  | <b>(2.212.642)</b>   |
| <b>Global High Yield Bond</b>                |                  |                  |         |                        |                                  |  |
| USD  | 47.568.239       | 03/04/2024       | EUR     | 43.865.771             | Standard Chartered Bank, London  | 180.610  |
| USD  | 240.558          | 03/04/2024       | GBP     | 190.260                | Barclays Bank, London            | 222  |
| USD  | 1.086.822        | 03/04/2024       | EUR     | 1.000.000              | BNP Paribas                      | 6.535  |
| USD  | 1.196.561        | 03/04/2024       | EUR     | 1.100.000              | Morgan Stanley, London           | 8.246  |
| USD  | 2.487.809        | 04/04/2024       | EUR     | 2.300.000              | BNP Paribas                      | 3.050  |
| USD  | 11.417           | 30.04.2024       | EUR     | 10.496                 | HSBC Bank PLC                    | 66   |
| USD  | 61.698           | 30.04.2024       | EUR     | 56.959                 | HSBC Bank PLC                    | 99   |
| USD  | 12.469           | 30.04.2024       | EUR     | 11.512                 | HSBC Bank PLC                    | 20   |
| USD  | 92.052           | 30.04.2024       | GBP     | 72.658                 | HSBC Bank PLC                    | 257  |
| GBP  | 16.119           | 30.04.2024       | USD     | 20.360                 | HSBC Bank PLC                    | 5  |
| JPY  | 760.514.288      | 30.04.2024       | USD     | 5.041.931              | HSBC Bank PLC                    | 5.354  |
| JPY  | 13.366.544       | 30.04.2024       | USD     | 88.615                 | HSBC Bank PLC                    | 94   |
| JPY  | 1.045.783.760    | 30.04.2024       | USD     | 6.933.163              | HSBC Bank PLC                    | 7.362  |
| CNH  | 19.944           | 30.04.2024       | USD     | 2.748                  | HSBC Bank PLC                    | 1  |
| USD  | 192              | 30.04.2024       | AUD     | 292                    | HSBC Bank PLC                    | 1  |
| AUD  | 1.470            | 30.04.2024       | USD     | 959                    | HSBC Bank PLC                    | -  |
| USD  | 2.780            | 30.04.2024       | AUD     | 4.248                  | HSBC Bank PLC                    | 6  |
| USD  | 2.447            | 30.04.2024       | AUD     | 3.740                  | HSBC Bank PLC                    | 5  |
| USD  | 55.397.667       | 15/05/2024       | EUR     | 50.500.000             | BNP Paribas                      | 752.967  |
| USD  | 1.746.941        | 15/05/2024       | EUR     | 1.600.000              | Barclays Bank, London            | 15.624   |
| <b>USD</b>                                   |                  |                  |         |                        |                                  | <b>980.524</b>   |

# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

| Teilfonds                                   | Im Austausch für | Erfüllungstermin | Währung | Kontrakt zur Lieferung | Kontrahent                      | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|---|------------------|------------------|---------|------------------------|---------------------------------|--|
| <b>Global High Yield Bond (Fortsetzung)</b> |                  |                  |         |                        |                                 |  |
| EUR   | 775.000          | 03/04/2024       | USD     | 842.103                | Morgan Stanley, London          | (4.881)  |
| GBP   | 350.000          | 03/04/2024       | USD     | 444.745                | Barclays Bank, London           | (2.625)  |
| EUR   | 12.700.000       | 03/04/2024       | USD     | 13.838.343             | Morgan Stanley, London          | (118.696)  |
| EUR   | 14.450.000       | 03/04/2024       | USD     | 15.850.782             | Barclays Bank, London           | (240.632)  |
| EUR   | 1.000.000        | 03/04/2024       | USD     | 1.081.949              | Standard Chartered Bank, London | (1.662)  |
| USD   | 94.349.306       | 04/04/2024       | EUR     | 88.000.000             | Crédit Agricole                 | (719.775)  |
| EUR   | 8.000.000        | 04/04/2024       | USD     | 8.707.385              | Crédit Agricole                 | (64.741)   |
| EUR   | 2.500.000        | 04/04/2024       | USD     | 2.736.311              | Bank of America                 | (35.485)   |
| EUR   | 2.000.000        | 04/04/2024       | USD     | 2.186.652              | BNP Paribas                     | (25.991)   |
| EUR   | 2.000.000        | 04/04/2024       | USD     | 2.180.048              | Crédit Agricole                 | (19.387)   |
| EUR   | 3.441            | 30.04.2024       | USD     | 3.761                  | HSBC Bank PLC                   | (40)   |
| EUR   | 5.817.883        | 30.04.2024       | USD     | 6.358.795              | HSBC Bank PLC                   | (67.002)   |
| EUR   | 4.849.136        | 30.04.2024       | USD     | 5.299.979              | HSBC Bank PLC                   | (55.845)   |
| EUR   | 18.346.672       | 30.04.2024       | USD     | 20.052.435             | HSBC Bank PLC                   | (211.291)  |
| EUR   | 9.262            | 30.04.2024       | USD     | 10.075                 | HSBC Bank PLC                   | (58)   |
| EUR   | 6.871            | 30.04.2024       | USD     | 7.458                  | HSBC Bank PLC                   | (27)   |
| EUR   | 7.946            | 30.04.2024       | USD     | 8.617                  | HSBC Bank PLC                   | (23)   |
| EUR   | 39.766           | 30.04.2024       | USD     | 43.075                 | HSBC Bank PLC                   | (69)   |
| USD   | 299.697          | 30.04.2024       | EUR     | 277.846                | HSBC Bank PLC                   | (781)  |
| EUR   | 4.681.555        | 30.04.2024       | USD     | 5.116.818              | HSBC Bank PLC                   | (53.915)   |
| EUR   | 4.938            | 30.04.2024       | USD     | 5.348                  | HSBC Bank PLC                   | (9)  |
| GBP   | 954.053          | 30.04.2024       | USD     | 1.218.879              | HSBC Bank PLC                   | (13.538)   |
| GBP   | 80.420.835       | 30.04.2024       | USD     | 102.744.050            | HSBC Bank PLC                   | (1.141.167)  |
| USD   | 112.423          | 30.04.2024       | GBP     | 89.199                 | HSBC Bank PLC                   | (270)  |
| GBP   | 9.259            | 30.04.2024       | USD     | 11.709                 | HSBC Bank PLC                   | (11)   |
| USD   | 4.361            | 30.04.2024       | GBP     | 3.453                  | HSBC Bank PLC                   | (2)  |
| USD   | 1.496.722        | 30.04.2024       | GBP     | 1.188.341              | HSBC Bank PLC                   | (4.616)  |
| GBP   | 20.750           | 30.04.2024       | USD     | 26.510                 | HSBC Bank PLC                   | (294)  |
| GBP   | 129.358          | 30.04.2024       | USD     | 165.265                | HSBC Bank PLC                   | (1.836)  |
| USD   | 2.434            | 30.04.2024       | GBP     | 1.933                  | HSBC Bank PLC                   | (8)  |
| USD   | 32.055           | 30.04.2024       | JPY     | 4.834.043              | HSBC Bank PLC                   | (27)   |
| USD   | 122.617          | 30.04.2024       | JPY     | 18.491.006             | HSBC Bank PLC                   | (102)  |
| CHF   | 414.620          | 30.04.2024       | USD     | 465.327                | HSBC Bank PLC                   | (3.619)  |
| USD   | 7.647            | 30.04.2024       | CHF     | 6.910                  | HSBC Bank PLC                   | (48)   |
| SGD   | 1.687.938        | 30.04.2024       | USD     | 1.262.822              | HSBC Bank PLC                   | (10.448)   |
| SGD   | 6.577            | 30.04.2024       | USD     | 4.893                  | HSBC Bank PLC                   | (14)   |
| SGD   | 12.673           | 30.04.2024       | USD     | 9.429                  | HSBC Bank PLC                   | (26)   |
| SGD   | 1.705            | 30.04.2024       | USD     | 1.266                  | HSBC Bank PLC                   | (1)  |
| USD   | 19.375           | 30.04.2024       | SGD     | 26.146                 | HSBC Bank PLC                   | (24)   |
| CNH   | 11.749.695       | 30.04.2024       | USD     | 1.633.820              | HSBC Bank PLC                   | (14.123)   |
| AUD   | 15.582.782       | 30.04.2024       | USD     | 10.309.522             | HSBC Bank PLC                   | (135.460)  |
| AUD   | 109.660          | 30.04.2024       | USD     | 71.598                 | HSBC Bank PLC                   | (1)  |
| AUD   | 219.206          | 30.04.2024       | USD     | 145.026                | HSBC Bank PLC                   | (1.906)  |
| USD   | 2.167            | 30.04.2024       | AUD     | 3.338                  | HSBC Bank PLC                   | (12)   |
| CAD   | 553.312          | 30.04.2024       | USD     | 410.500                | HSBC Bank PLC                   | (1.440)  |
| <b>USD</b>                                  |                  |                  |         |                        |                                 | <b>(2.951.928)</b>   |

# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

| Teilfonds  | Im Austausch für | Erfüllungstermin | Währung | Kontrakt zur Lieferung | Kontrahent                          | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|--|------------------|------------------|---------|------------------------|-------------------------------------|--|
| <b>Global High Yield ESG Bond</b>                |                  |                  |         |                        |                                     |  |
| USD  | 374.361          | 03/04/2024       | EUR     | 345.000                | Standard Chartered Bank, London     | 1.731  |
| USD  | 108.179          | 04/04/2024       | EUR     | 100.000                | Bank of America                     | 166  |
| USD  | 435.975          | 04/04/2024       | EUR     | 400.000                | Barclays Bank, London               | 3.923  |
| USD  | 5.069            | 30.04.2024       | EUR     | 4.660                  | HSBC Bank PLC                       | 30   |
| GBP  | 9.929            | 30.04.2024       | USD     | 12.514                 | HSBC Bank PLC                       | 31   |
| GBP  | 19.374           | 30.04.2024       | USD     | 24.469                 | HSBC Bank PLC                       | 10   |
| GBP  | 731              | 30.04.2024       | USD     | 923                    | HSBC Bank PLC                       | -  |
| USD  | 4.169.527        | 15/05/2024       | EUR     | 3.800.000              | Crédit Agricole                     | 58.414   |
| USD  | 81.899           | 15/05/2024       | EUR     | 75.000                 | Bank of America                     | 758  |
|  |                  |                  |         |                        | <b>USD</b>                          | <b>65.063</b>  |
| USD  | 3.967.899        | 04/04/2024       | EUR     | 3.700.000              | Société Générale, Paris             | (28.581)   |
| EUR  | 3.815            | 30.04.2024       | USD     | 4.170                  | HSBC Bank PLC                       | (45)   |
| EUR  | 572.450          | 30.04.2024       | USD     | 625.673                | HSBC Bank PLC                       | (6.707)  |
| USD  | 8.117            | 30.04.2024       | EUR     | 7.525                  | HSBC Bank PLC                       | (20)   |
| GBP  | 3.398            | 30.04.2024       | USD     | 4.342                  | HSBC Bank PLC                       | (48)   |
| GBP  | 8.004.385        | 30.04.2024       | USD     | 10.226.243             | HSBC Bank PLC                       | (113.186)  |
| GBP  | 3.569            | 30.04.2024       | USD     | 4.522                  | HSBC Bank PLC                       | (12)   |
| GBP  | 26.131           | 30.04.2024       | USD     | 33.047                 | HSBC Bank PLC                       | (31)   |
| USD  | 131.427          | 30.04.2024       | GBP     | 104.348                | HSBC Bank PLC                       | (410)  |
| GBP  | 9.731            | 30.04.2024       | USD     | 12.432                 | HSBC Bank PLC                       | (138)  |
| CHF  | 4.041            | 30.04.2024       | USD     | 4.535                  | HSBC Bank PLC                       | (35)   |
| CHF  | 9.123            | 30.04.2024       | USD     | 10.238                 | HSBC Bank PLC                       | (80)   |
| EUR  | 9.387            | 30.04.2024       | USD     | 10.260                 | HSBC Bank PLC                       | (110)  |
| USD  | 372.518          | 03/05/2024       | EUR     | 345.000                | Standard Chartered Bank, London     | (559)  |
|  |                  |                  |         |                        | <b>USD</b>                          | <b>(149.962)</b>   |
| <b>Global High Yield Securitised Credit Bond</b> |                  |                  |         |                        |                                     |  |
| JPY  | 528.476.289      | 30.04.2024       | USD     | 3.503.604              | HSBC Bank PLC                       | 4.673  |
| JPY  | 25.930.573       | 30.04.2024       | USD     | 171.910                | HSBC Bank PLC                       | 229  |
|  |                  |                  |         |                        | <b>USD</b>                          | <b>4.902</b>   |
| USD  | 10.683.970       | 30.04.2024       | EUR     | 9.860.000              | HSBC, Sheffield                     | (16.402)   |
| USD  | 8.441.000        | 30.04.2024       | GBP     | 6.682.000              | HSBC, Sheffield                     | (9.637)  |
| USD  | 518.380          | 30.04.2024       | AUD     | 792.600                | J.P. Morgan Chase Bank, New York    | (273)  |
| EUR  | 5.045.654        | 30.04.2024       | USD     | 5.514.769              | HSBC Bank PLC                       | (39.071)   |
|  |                  |                  |         |                        | <b>USD</b>                          | <b>(65.383)</b>  |
| <b>Global Inflation Linked Bond</b>              |                  |                  |         |                        |                                     |  |
| USD  | 383.491          | 10/04/2024       | AUD     | 580.000                | UBS, London                         | 5.023  |
| USD  | 759.217          | 10/04/2024       | EUR     | 700.000                | Crédit Agricole                     | 2.944  |
| USD  | 449.809          | 10/04/2024       | AUD     | 680.000                | State Street Bank and Trust Company | 6.089  |
| USD  | 837.765          | 10/04/2024       | EUR     | 770.000                | Crédit Agricole                     | 5.865  |
| USD  | 356.928          | 10/04/2024       | EUR     | 330.000                | NatWest National Westminster Bank   | 399  |
| USD  | 24.556.249       | 10/04/2024       | CAD     | 33.200.000             | Merrill Lynch International Bank    | 19.842   |
| USD  | 653.594          | 10/04/2024       | AUD     | 1.000.000              | Citigroup Global Markets Limited    | 1.063  |
| USD  | 1.487.197        | 10/04/2024       | EUR     | 1.375.000              | NatWest National Westminster Bank   | 1.662  |
| USD  | 784.400          | 10/04/2024       | AUD     | 1.190.000              | UBS, London                         | 7.889  |
| USD  | 2.478.875        | 10/04/2024       | EUR     | 2.280.000              | UBS, London                         | 15.587   |
| USD  | 326.264          | 10/04/2024       | EUR     | 300.000                | NatWest National Westminster Bank   | 2.147  |
| USD  | 260.829          | 10/04/2024       | EUR     | 240.000                | Merrill Lynch International Bank    | 1.536  |
| USD  | 1.473.531        | 11/04/2024       | GBP     | 1.160.000              | State Street Bank and Trust Company | 8.096  |

# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

| Teilfonds   | Im Austausch für | Erfüllungstermin | Währung | Kontrakt zur Lieferung | Kontrahent                          | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|---|------------------|------------------|---------|------------------------|-------------------------------------|--|
| <b>Global Inflation Linked Bond (Fortsetzung)</b> |                  |                  |         |                        |                                     |  |
| USD   | 1.349.302        | 11/04/2024       | GBP     | 1.060.000              | UBS, London                         | 10.197   |
| USD   | 8.603.921        | 11/04/2024       | JPY     | 1.260.300.000          | Crédit Agricole                     | 263.913  |
| USD   | 1.457.301        | 11/04/2024       | GBP     | 1.150.000              | NatWest National Westminster Bank   | 4.499  |
| USD   | 2.351.833        | 11/04/2024       | GBP     | 1.855.000              | HSBC, Sheffield                     | 8.400  |
| USD   | 21.163.956       | 26/04/2024       | NZD     | 34.500.000             | NatWest National Westminster Bank   | 527.247  |
| USD   | 17.497.678       | 26/04/2024       | SEK     | 182.000.000            | HSBC, Sheffield                     | 460.828  |
| IDR   | 44.600.000.000   | 30.04.2024       | USD     | 2.802.206              | UBS, London                         | 5.085  |
| USD   | 2.867.862        | 30.04.2024       | MYR     | 13.400.000             | Goldman Sachs International, London | 56.127   |
| USD   | 1.196            | 30.04.2024       | EUR     | 1.104                  | HSBC Bank PLC                       | 2  |
| USD   | 5.221            | 30.04.2024       | EUR     | 4.815                  | HSBC Bank PLC                       | 15   |
| USD   | 25.168           | 30.04.2024       | EUR     | 23.138                 | HSBC Bank PLC                       | 150  |
| USD   | 104              | 30.04.2024       | EUR     | 96                     | HSBC Bank PLC                       | -  |
| USD   | 5.246            | 30.04.2024       | EUR     | 4.823                  | HSBC Bank PLC                       | 31   |
| USD   | 6.276            | 30.04.2024       | EUR     | 5.794                  | HSBC Bank PLC                       | 11   |
| USD   | 3                | 30.04.2024       | EUR     | 3                      | HSBC Bank PLC                       | -  |
| USD   | 24.488           | 30.04.2024       | EUR     | 22.582                 | HSBC Bank PLC                       | 71   |
| USD   | 19.631           | 30.04.2024       | EUR     | 18.123                 | HSBC Bank PLC                       | 35   |
| USD   | 3.591            | 30.04.2024       | EUR     | 3.315                  | HSBC Bank PLC                       | 6  |
| USD   | 79.475           | 30.04.2024       | EUR     | 73.374                 | HSBC Bank PLC                       | 139  |
| USD   | 26.930           | 30.04.2024       | GBP     | 21.256                 | HSBC Bank PLC                       | 74   |
| GBP   | 682.577          | 30.04.2024       | USD     | 861.275                | HSBC Bank PLC                       | 1.120  |
| USD   | 28.520           | 30.04.2024       | GBP     | 22.552                 | HSBC Bank PLC                       | 27   |
| GBP   | 34.226           | 30.04.2024       | USD     | 43.225                 | HSBC Bank PLC                       | 17   |
| GBP   | 27.388           | 30.04.2024       | USD     | 34.593                 | HSBC Bank PLC                       | 10   |
| USD   | 505.518          | 07/06/2024       | GBP     | 400.000                | State Street Bank and Trust Company | 36   |
| <b>USD</b>  |                  |                  |         |                        |                                     | <b>1.416.182</b>   |
| USD   | 1.142.521        | 10/04/2024       | EUR     | 1.060.000              | State Street Bank and Trust Company | (2.692)  |
| USD   | 22.040.888       | 10/04/2024       | AUD     | 33.830.000             | UBS, London                         | (34.223)   |
| USD   | 166.077.859      | 10/04/2024       | EUR     | 154.400.000            | HSBC, Sheffield                     | (734.282)  |
| USD   | 1.133.716        | 10/04/2024       | EUR     | 1.050.000              | State Street Bank and Trust Company | (693)  |
| USD   | 1.106.560        | 10/04/2024       | EUR     | 1.026.000              | State Street Bank and Trust Company | (1.920)  |
| USD   | 1.706.030        | 10/04/2024       | EUR     | 1.580.000              | State Street Bank and Trust Company | (986)  |
| USD   | 42.927           | 10/04/2024       | EUR     | 40.000                 | State Street Bank and Trust Company | (288)  |
| USD   | 763.290          | 10/04/2024       | EUR     | 710.000                | State Street Bank and Trust Company | (3.786)  |
| EUR   | 530.000          | 10/04/2024       | USD     | 576.099                | UBS, London                         | (3.492)  |
| EUR   | 1.420.000        | 10/04/2024       | USD     | 1.542.979              | NatWest National Westminster Bank   | (8.826)  |
| EUR   | 1.000.000        | 10/04/2024       | USD     | 1.083.866              | NatWest National Westminster Bank   | (3.476)  |
| EUR   | 350.000          | 10/04/2024       | USD     | 383.297                | State Street Bank and Trust Company | (5.161)  |
| EUR   | 2.200.000        | 10/04/2024       | USD     | 2.410.630              | UBS, London                         | (33.773)   |
| USD   | 857.740          | 11/04/2024       | GBP     | 680.000                | State Street Bank and Trust Company | (1.308)  |
| USD   | 115.032.530      | 11/04/2024       | GBP     | 91.070.000             | Crédit Agricole                     | (16.756)   |
| USD   | 1.449.818        | 11/04/2024       | GBP     | 1.150.000              | HSBC, Sheffield                     | (2.984)  |
| GBP   | 2.380.000        | 11/04/2024       | USD     | 3.017.645              | NatWest National Westminster Bank   | (10.976)   |

# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

| Teilfonds  | Im Austausch für | Erfüllungstermin | Währung | Kontrakt zur Lieferung | Kontrahent                          | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|--|------------------|------------------|---------|------------------------|-------------------------------------|--|
| <b>Global Inflation Linked Bond (Fortsetzung)</b>      |                  |                  |         |                        |                                     |  |
| USD  | 1.010.429        | 11/04/2024       | GBP     | 800.000                | UBS, London                         | (216)  |
| GBP  | 500.000          | 11/04/2024       | USD     | 639.762                | HSBC, Sheffield                     | (8.109)  |
| GBP  | 600.000          | 11/04/2024       | USD     | 771.373                | UBS, London                         | (13.389)   |
| USD  | 3.323.513        | 26/04/2024       | MXN     | 58.000.000             | State Street Bank and Trust Company | (152.925)  |
| MYR  | 13.400.000       | 30.04.2024       | USD     | 2.845.917              | Crédit Agricole                     | (34.183)   |
| AUD  | 8.500.000        | 30.04.2024       | USD     | 5.622.937              | Merrill Lynch International Bank    | (73.253)   |
| JPY  | 1.670.000.000    | 30.04.2024       | USD     | 11.456.765             | Merrill Lynch International Bank    | (373.520)  |
| EUR  | 10.338.006       | 30.04.2024       | USD     | 11.299.171             | HSBC Bank PLC                       | (121.138)  |
| EUR  | 65.029           | 30.04.2024       | USD     | 70.448                 | HSBC Bank PLC                       | (135)  |
| EUR  | 4.549.482        | 30.04.2024       | USD     | 4.972.465              | HSBC Bank PLC                       | (53.309)   |
| EUR  | 28.544           | 30.04.2024       | USD     | 30.922                 | HSBC Bank PLC                       | (59)   |
| EUR  | 1.209.829        | 30.04.2024       | USD     | 1.322.311              | HSBC Bank PLC                       | (14.176)   |
| EUR  | 7.492            | 30.04.2024       | USD     | 8.117                  | HSBC Bank PLC                       | (16)   |
| EUR  | 3.523.703        | 30.04.2024       | USD     | 3.851.315              | HSBC Bank PLC                       | (41.290)   |
| EUR  | 22.174           | 30.04.2024       | USD     | 24.021                 | HSBC Bank PLC                       | (46)   |
| EUR  | 48.989.608       | 30.04.2024       | USD     | 53.544.368             | HSBC Bank PLC                       | (574.045)  |
| EUR  | 309.905          | 30.04.2024       | USD     | 335.730                | HSBC Bank PLC                       | (643)  |
| EUR  | 28.742.979       | 30.04.2024       | USD     | 31.415.329             | HSBC Bank PLC                       | (336.802)  |
| EUR  | 11.713           | 30.04.2024       | USD     | 12.741                 | HSBC Bank PLC                       | (76)   |
| EUR  | 182.172          | 30.04.2024       | USD     | 197.352                | HSBC Bank PLC                       | (378)  |
| EUR  | 9.854            | 30.04.2024       | USD     | 10.695                 | HSBC Bank PLC                       | (40)   |
| EUR  | 20.776           | 30.04.2024       | USD     | 22.529                 | HSBC Bank PLC                       | (65)   |
| EUR  | 4.428            | 30.04.2024       | USD     | 4.797                  | HSBC Bank PLC                       | (9)  |
| GBP  | 105.325.373      | 30.04.2024       | USD     | 134.561.591            | HSBC Bank PLC                       | (1.489.351)  |
| USD  | 33.498           | 30.04.2024       | GBP     | 26.578                 | HSBC Bank PLC                       | (82)   |
| CHF  | 861.914          | 30.04.2024       | USD     | 967.324                | HSBC Bank PLC                       | (7.524)  |
| CHF  | 5.202            | 30.04.2024       | USD     | 5.817                  | HSBC Bank PLC                       | (24)   |
| SGD  | 7.882.843        | 30.04.2024       | USD     | 5.897.507              | HSBC Bank PLC                       | (49.009)   |
| SGD  | 48.742           | 30.04.2024       | USD     | 36.255                 | HSBC Bank PLC                       | (92)   |
| SGD  | 3.549            | 30.04.2024       | USD     | 2.641                  | HSBC Bank PLC                       | (8)  |
| SGD  | 45.323           | 30.04.2024       | USD     | 33.721                 | HSBC Bank PLC                       | (94)   |
| SGD  | 5.925            | 30.04.2024       | USD     | 4.400                  | HSBC Bank PLC                       | (4)  |
| <b>USD</b>   |                  |                  |         |                        |                                     | <b>(4.209.632)</b>   |
| <b>Global Investment Grade Securitised Credit Bond</b> |                  |                  |         |                        |                                     |  |
| AUD  | 10.000.000       | 08/04/2024       | USD     | 6.494.709              | HSBC, Sheffield                     | 30.224   |
| USD  | 464.416.773      | 30.04.2024       | EUR     | 428.600.000            | HSBC, Sheffield                     | 990.322  |
| USD  | 125.801.690      | 30.04.2024       | AUD     | 192.350.000            | J.P. Morgan Chase Bank, New York    | 215.586  |
| GBP  | 27.440           | 30.04.2024       | USD     | 34.584                 | HSBC Bank PLC                       | 84   |
| GBP  | 92.198           | 30.04.2024       | USD     | 116.452                | HSBC Bank PLC                       | 34   |
| USD  | 50.641           | 30.04.2024       | GBP     | 39.972                 | HSBC Bank PLC                       | 139  |
| USD  | 22.234           | 30.04.2024       | GBP     | 17.581                 | HSBC Bank PLC                       | 21   |
| GBP  | 8.652            | 30.04.2024       | USD     | 10.928                 | HSBC Bank PLC                       | 3  |
| USD  | 698              | 30.04.2024       | GBP     | 551                    | HSBC Bank PLC                       | 2  |
| GBP  | 64.408           | 30.04.2024       | USD     | 81.344                 | HSBC Bank PLC                       | 32   |

# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

| Teilfonds  | Im Austausch für | Erfüllungstermin | Währung | Kontrakt zur Lieferung | Kontrahent      | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|--|------------------|------------------|---------|------------------------|-----------------|--|
| <b>Global Investment Grade Securitised Credit Bond (Fortsetzung)</b> |                  |                  |         |                        |                 |  |
| GBP  | 27.063           | 30.04.2024       | USD     | 34.183                 | HSBC Bank PLC   | 10   |
| JPY  | 2.527.088.141    | 30.04.2024       | USD     | 16.753.668             | HSBC Bank PLC   | 17.790   |
| JPY  | 51.542.325       | 30.04.2024       | USD     | 341.707                | HSBC Bank PLC   | 363  |
| JPY  | 149.675          | 30.04.2024       | USD     | 992                    | HSBC Bank PLC   | 1  |
| CNH  | 99.320           | 30.04.2024       | USD     | 13.685                 | HSBC Bank PLC   | 7  |
| USD  | 87.336           | 30.04.2024       | EUR     | 80.631                 | HSBC Bank PLC   | 153  |
|  |                  |                  |         |                        | <b>USD</b>      | <b>1.254.771</b>   |
| USD  | 258.296.887      | 30.04.2024       | GBP     | 204.471.000            | HSBC, Sheffield | (39.855)   |
| USD  | 6.498.906        | 30.04.2024       | AUD     | 10.000.000             | HSBC, Sheffield | (30.135)   |
| EUR  | 1.866            | 30.04.2024       | USD     | 2.039                  | HSBC Bank PLC   | (22)   |
| EUR  | 1.567.384        | 30.04.2024       | USD     | 1.713.110              | HSBC Bank PLC   | (18.366)   |
| EUR  | 646.835          | 30.04.2024       | USD     | 706.974                | HSBC Bank PLC   | (7.579)  |
| EUR  | 282.378          | 30.04.2024       | USD     | 308.632                | HSBC Bank PLC   | (3.309)  |
| EUR  | 189.278          | 30.04.2024       | USD     | 206.876                | HSBC Bank PLC   | (2.218)  |
| GBP  | 26.942.875       | 30.04.2024       | USD     | 34.421.678             | HSBC Bank PLC   | (380.985)  |
| GBP  | 284.772          | 30.04.2024       | USD     | 360.786                | HSBC Bank PLC   | (994)  |
| GBP  | 14.760           | 30.04.2024       | USD     | 18.665                 | HSBC Bank PLC   | (18)   |
| USD  | 330.603          | 30.04.2024       | GBP     | 261.771                | HSBC Bank PLC   | (129)  |
| GBP  | 248.867.624      | 30.04.2024       | USD     | 317.948.299            | HSBC Bank PLC   | (3.519.107)  |
| USD  | 49.271           | 30.04.2024       | GBP     | 39.093                 | HSBC Bank PLC   | (120)  |
| USD  | 14.915           | 30.04.2024       | GBP     | 11.809                 | HSBC Bank PLC   | (6)  |
| USD  | 4.525.184        | 30.04.2024       | GBP     | 3.592.824              | HSBC Bank PLC   | (14.132)   |
| GBP  | 75.123.883       | 30.04.2024       | USD     | 95.976.771             | HSBC Bank PLC   | (1.062.288)  |
| USD  | 2.752            | 30.04.2024       | GBP     | 2.184                  | HSBC Bank PLC   | (7)  |
| GBP  | 23.291           | 30.04.2024       | USD     | 29.454                 | HSBC Bank PLC   | (28)   |
| GBP  | 62.709.578       | 30.04.2024       | USD     | 80.116.503             | HSBC Bank PLC   | (886.743)  |
| GBP  | 2.200.000        | 30.04.2024       | USD     | 2.782.184              | HSBC Bank PLC   | (2.617)  |
| GBP  | 4.083.776        | 30.04.2024       | USD     | 5.217.350              | HSBC Bank PLC   | (57.747)   |
| USD  | 74.898           | 30.04.2024       | GBP     | 59.466                 | HSBC Bank PLC   | (234)  |
| JPY  | 17.931.895       | 30.04.2024       | USD     | 119.122                | HSBC Bank PLC   | (114)  |
| CHF  | 1.394.310        | 30.04.2024       | USD     | 1.564.831              | HSBC Bank PLC   | (12.171)   |
| USD  | 25.225           | 30.04.2024       | CHF     | 22.794                 | HSBC Bank PLC   | (158)  |
| SGD  | 52.265           | 30.04.2024       | USD     | 39.102                 | HSBC Bank PLC   | (325)  |
| SGD  | 7.934.085        | 30.04.2024       | USD     | 5.935.843              | HSBC Bank PLC   | (49.327)   |
| SGD  | 3.559            | 30.04.2024       | USD     | 2.648                  | HSBC Bank PLC   | (8)  |
| SGD  | 45.404           | 30.04.2024       | USD     | 33.781                 | HSBC Bank PLC   | (94)   |
| SGD  | 5.838            | 30.04.2024       | USD     | 4.335                  | HSBC Bank PLC   | (4)  |
| USD  | 88.477           | 30.04.2024       | SGD     | 119.397                | HSBC Bank PLC   | (107)  |
| SGD  | 13.918           | 30.04.2024       | USD     | 10.412                 | HSBC Bank PLC   | (87)   |
| CNH  | 200.282.401      | 30.04.2024       | USD     | 27.849.689             | HSBC Bank PLC   | (238.262)  |
| CNH  | 229.529          | 30.04.2024       | USD     | 31.861                 | HSBC Bank PLC   | (218)  |
| CNH  | 297.000          | 30.04.2024       | USD     | 41.050                 | HSBC Bank PLC   | (105)  |
| CNH  | 297.000          | 30.04.2024       | USD     | 40.976                 | HSBC Bank PLC   | (31)   |
| AUD  | 71.354.476       | 30.04.2024       | USD     | 47.207.907             | HSBC Bank PLC   | (620.277)  |
| AUD  | 17.227           | 30.04.2024       | USD     | 11.328                 | HSBC Bank PLC   | (80)   |

# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

| Teilfonds  | Im Austausch für | Erfüllungstermin | Währung | Kontrakt zur Lieferung | Kontrahent                        | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|--|------------------|------------------|---------|------------------------|-----------------------------------|--|
| <b>Global Investment Grade Securitised Credit Bond (Fortsetzung)</b> |                  |                  |         |                        |                                   |  |
| USD  | 162.284          | 30.04.2024       | AUD     | 248.658                | HSBC Bank PLC                     | (66)   |
| AUD  | 12.879           | 30.04.2024       | USD     | 8.426                  | HSBC Bank PLC                     | (17)   |
| AUD  | 304.526          | 30.04.2024       | USD     | 198.828                | HSBC Bank PLC                     | (1)  |
| AUD  | 867.281          | 30.04.2024       | USD     | 573.790                | HSBC Bank PLC                     | (7.539)  |
| USD  | 8.370            | 30.04.2024       | AUD     | 12.890                 | HSBC Bank PLC                     | (47)   |
| EUR  | 36.616.686       | 30.04.2024       | USD     | 40.021.085             | HSBC Bank PLC                     | (429.063)  |
| EUR  | 10.237           | 30.04.2024       | USD     | 11.136                 | HSBC Bank PLC                     | (66)   |
| EUR  | 13.756           | 30.04.2024       | USD     | 14.930                 | HSBC Bank PLC                     | (56)   |
| EUR  | 20.695           | 30.04.2024       | USD     | 22.442                 | HSBC Bank PLC                     | (65)   |
| EUR  | 12.908           | 30.04.2024       | USD     | 13.982                 | HSBC Bank PLC                     | (25)   |
| USD  | 614.923          | 30.04.2024       | EUR     | 570.089                | HSBC Bank PLC                     | (1.489)  |
| <b>USD</b>   |                  |                  |         |                        |                                   | <b>(7.386.441)</b>   |
| <b>Global Lower Carbon Bond</b>                                      |                  |                  |         |                        |                                   |  |
| USD  | 45.520.150       | 26/04/2024       | EUR     | 42.000.000             | Crédit Agricole                   | 114.671  |
| USD  | 8.698.316        | 26/04/2024       | EUR     | 8.000.000              | BNP Paribas                       | 49.653   |
| USD  | 6.232            | 30.04.2024       | EUR     | 5.730                  | HSBC Bank PLC                     | 37   |
| GBP  | 7.850            | 30.04.2024       | USD     | 9.905                  | HSBC Bank PLC                     | 13   |
| USD  | 3.617            | 30.04.2024       | GBP     | 2.855                  | HSBC Bank PLC                     | 10   |
| GBP  | 9.549            | 30.04.2024       | USD     | 12.036                 | HSBC Bank PLC                     | 29   |
| GBP  | 79.218           | 30.04.2024       | USD     | 99.957                 | HSBC Bank PLC                     | 130  |
| GBP  | 25.398           | 30.04.2024       | USD     | 32.076                 | HSBC Bank PLC                     | 13   |
| GBP  | 991              | 30.04.2024       | USD     | 1.252                  | HSBC Bank PLC                     | -  |
| GBP  | 50               | 30.04.2024       | USD     | 63                     | HSBC Bank PLC                     | -  |
| GBP  | 4.582            | 30.04.2024       | USD     | 5.781                  | HSBC Bank PLC                     | 8  |
| USD  | 22.595.270       | 30.04.2024       | GBP     | 17.840.000             | NatWest National Westminster Bank | 55.509   |
| USD  | 54.483.355       | 24/05/2024       | EUR     | 50.000.000             | BNP Paribas                       | 371.351  |
| <b>USD</b>   |                  |                  |         |                        |                                   | <b>591.424</b>   |
| EUR  | 2.000.000        | 26/04/2024       | USD     | 2.173.906              | Barclays Bank, London             | (11.740)   |
| EUR  | 9.275.492        | 30.04.2024       | USD     | 10.137.872             | HSBC Bank PLC                     | (108.687)  |
| EUR  | 92.707           | 30.04.2024       | USD     | 100.416                | HSBC Bank PLC                     | (176)  |
| EUR  | 52.674           | 30.04.2024       | USD     | 57.063                 | HSBC Bank PLC                     | (109)  |
| EUR  | 90.691           | 30.04.2024       | USD     | 98.430                 | HSBC Bank PLC                     | (370)  |
| EUR  | 24.260           | 30.04.2024       | USD     | 26.308                 | HSBC Bank PLC                     | (76)   |
| EUR  | 3.380            | 30.04.2024       | USD     | 3.661                  | HSBC Bank PLC                     | (7)  |
| EUR  | 138.131          | 30.04.2024       | USD     | 150.974                | HSBC Bank PLC                     | (1.619)  |
| EUR  | 784              | 30.04.2024       | USD     | 850                    | HSBC Bank PLC                     | (2)  |
| EUR  | 919.755          | 30.04.2024       | USD     | 1.005.269              | HSBC Bank PLC                     | (10.777)   |
| EUR  | 5.233            | 30.04.2024       | USD     | 5.669                  | HSBC Bank PLC                     | (11)   |

# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

| Teilfonds                                     | Im Austausch für | Erfüllungstermin | Währung | Kontrakt zur Lieferung | Kontrahent                          | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|---|------------------|------------------|---------|------------------------|-------------------------------------|--|
| <b>Global Lower Carbon Bond (Fortsetzung)</b> |                  |                  |         |                        |                                     |  |
| USD   | 8.060            | 30.04.2024       | EUR     | 7.473                  | HSBC Bank PLC                       | (20)   |
| GBP   | 1.345.736        | 30.04.2024       | USD     | 1.719.285              | HSBC Bank PLC                       | (19.029)   |
| GBP   | 13.477.831       | 30.04.2024       | USD     | 17.219.008             | HSBC Bank PLC                       | (190.583)  |
| GBP   | 38.710           | 30.04.2024       | USD     | 48.954                 | HSBC Bank PLC                       | (46)   |
| USD   | 136.660          | 30.04.2024       | GBP     | 108.503                | HSBC Bank PLC                       | (427)  |
| GBP   | 782.546          | 30.04.2024       | USD     | 999.765                | HSBC Bank PLC                       | (11.066)   |
| CHF   | 407.035          | 30.04.2024       | USD     | 456.815                | HSBC Bank PLC                       | (3.553)  |
| CHF   | 2.205            | 30.04.2024       | USD     | 2.465                  | HSBC Bank PLC                       | (10)   |
| USD   | 4.121            | 30.04.2024       | CHF     | 3.724                  | HSBC Bank PLC                       | (26)   |
| SGD   | 3.433.945        | 30.04.2024       | USD     | 2.569.088              | HSBC Bank PLC                       | (21.349)   |
| SGD   | 18.953           | 30.04.2024       | USD     | 14.098                 | HSBC Bank PLC                       | (36)   |
| AUD   | 3.101.631        | 30.04.2024       | USD     | 2.052.030              | HSBC Bank PLC                       | (26.962)   |
| AUD   | 17.618           | 30.04.2024       | USD     | 11.512                 | HSBC Bank PLC                       | (10)   |
| EUR   | 800.000          | 23/12/2024       | USD     | 888.221                | Société Générale, Paris             | (13.920)   |
| <b>USD</b>                                    |                  |                  |         |                        |                                     | <b>(420.611)</b>   |
| <b>Global Securitised Credit Bond</b>         |                  |                  |         |                        |                                     |  |
| JPY   | 3.127.859.153    | 30.04.2024       | USD     | 20.736.560             | HSBC Bank PLC                       | 27.656   |
| JPY   | 46.595.741       | 30.04.2024       | USD     | 308.913                | HSBC Bank PLC                       | 412  |
| <b>USD</b>                                    |                  |                  |         |                        |                                     | <b>28.068</b>  |
| USD   | 2.697.853        | 30.04.2024       | AUD     | 4.125.000              | J.P. Morgan Chase Bank, New York    | (1.419)  |
| USD   | 11.377.452       | 30.04.2024       | EUR     | 10.500.000             | HSBC, Sheffield                     | (17.467)   |
| USD   | 12.018.509       | 30.04.2024       | GBP     | 9.514.000              | HSBC, Sheffield                     | (13.721)   |
| EUR   | 257.564          | 30.04.2024       | USD     | 281.511                | HSBC Bank PLC                       | (1.994)  |
| EUR   | 4.907.792        | 30.04.2024       | USD     | 5.364.089              | HSBC Bank PLC                       | (38.004)   |
| GBP   | 4.280.007        | 30.04.2024       | USD     | 5.468.052              | HSBC Bank PLC                       | (55.183)   |
| GBP   | 1.664.617        | 30.04.2024       | USD     | 2.126.681              | HSBC Bank PLC                       | (21.462)   |
| GBP   | 5.660.404        | 30.04.2024       | USD     | 7.231.620              | HSBC Bank PLC                       | (72.981)   |
| <b>USD</b>                                    |                  |                  |         |                        |                                     | <b>(222.231)</b>   |
| <b>Global Short Duration Bond</b>             |                  |                  |         |                        |                                     |  |
| USD   | 4.128.702        | 10/04/2024       | EUR     | 3.800.000              | Crédit Agricole                     | 23.222   |
| USD   | 2.397.677        | 10/04/2024       | EUR     | 2.200.000              | UBS, London                         | 20.820   |
| USD   | 10.264.849       | 10/04/2024       | EUR     | 9.400.000              | State Street Bank and Trust Company | 109.187  |
| USD   | 3.857.367        | 10/04/2024       | CAD     | 5.200.000              | State Street Bank and Trust Company | 14.316   |
| USD   | 33.683.482       | 10/04/2024       | CAD     | 45.540.000             | Merrill Lynch International Bank    | 27.217   |
| USD   | 3.269.425        | 10/04/2024       | AUD     | 5.000.000              | Citigroup Global Markets Limited    | 6.772  |
| USD   | 130.897          | 10/04/2024       | AUD     | 200.000                | HSBC, Sheffield                     | 391  |
| USD   | 3.914.014        | 10/04/2024       | EUR     | 3.600.000              | UBS, London                         | 24.611   |
| USD   | 17.413.730       | 10/04/2024       | EUR     | 16.060.000             | UBS, London                         | 62.674   |



# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

| Teilfonds                                       | Im Austausch für | Erfüllungstermin | Währung | Kontrakt zur Lieferung | Kontrahent                          | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|---|------------------|------------------|---------|------------------------|-------------------------------------|--|
| <b>Global Short Duration Bond (Fortsetzung)</b> |                  |                  |         |                        |                                     |  |
| USD   | 6.330.849        | 10/04/2024       | EUR     | 5.830.000              | NatWest National Westminster Bank   | 32.179   |
| USD   | 8.149.936        | 10/04/2024       | EUR     | 7.500.000              | State Street Bank and Trust Company | 47.014   |
| USD   | 5.989.115        | 10/04/2024       | EUR     | 5.500.000              | State Street Bank and Trust Company | 46.973   |
| USD   | 6.896.327        | 10/04/2024       | EUR     | 6.300.000              | NatWest National Westminster Bank   | 89.873   |
| USD   | 9.409.263        | 10/04/2024       | EUR     | 8.600.000              | State Street Bank and Trust Company | 117.913  |
| USD   | 4.655.531        | 10/04/2024       | EUR     | 4.250.000              | Merrill Lynch International Bank    | 63.875   |
| USD   | 8.668.367        | 10/04/2024       | GBP     | 6.800.000              | Merrill Lynch International Bank    | 77.934   |
| USD   | 4.663.036        | 10/04/2024       | EUR     | 4.300.000              | UBS, London                         | 17.361   |
| USD   | 4.231.863        | 10/04/2024       | EUR     | 3.900.000              | Crédit Agricole                     | 18.344   |
| USD   | 32.564.233       | 11/04/2024       | JPY     | 4.770.000.000          | Crédit Agricole                     | 998.862  |
| USD   | 9.477.347        | 11/04/2024       | GBP     | 7.500.000              | State Street Bank and Trust Company | 2.551  |
| USD   | 5.452.806        | 11/04/2024       | GBP     | 4.300.000              | HSBC, Sheffield                     | 20.590   |
| USD   | 3.348.490        | 11/04/2024       | GBP     | 2.640.000              | HSBC, Sheffield                     | 13.362   |
| USD   | 2.283.923        | 11/04/2024       | GBP     | 1.800.000              | Crédit Agricole                     | 9.972  |
| USD   | 6.543.667        | 11/04/2024       | GBP     | 5.100.000              | NatWest National Westminster Bank   | 100.806  |
| USD   | 9.903.470        | 26/04/2024       | CNY     | 70.900.000             | Crédit Agricole                     | 36.288   |
| USD   | 3.548.776        | 26/04/2024       | NZD     | 5.800.000              | NatWest National Westminster Bank   | 79.416   |
| USD   | 10.725.912       | 26/04/2024       | KRW     | 14.300.000.000         | Citigroup Global Markets Limited    | 108.169  |
| USD   | 96.831.382       | 26/04/2024       | CNY     | 690.000.000            | Merrill Lynch International Bank    | 803.803  |
| USD   | 35.009.477       | 26/04/2024       | NZD     | 57.070.000             | NatWest National Westminster Bank   | 872.171  |
| USD   | 10.944.893       | 26/04/2024       | CZK     | 250.000.000            | Goldman Sachs International, London | 268.900  |
| USD   | 7.249.038        | 26/04/2024       | SEK     | 75.400.000             | HSBC, Sheffield                     | 190.914  |
| USD   | 6.479.368        | 26/04/2024       | CHF     | 5.550.000              | NatWest National Westminster Bank   | 301.798  |
| USD   | 3.845.949        | 26/04/2024       | NZD     | 6.300.000              | HSBC, Sheffield                     | 77.506   |
| USD   | 3.574.321        | 26/04/2024       | CZK     | 83.000.000             | Goldman Sachs International, London | 29.892   |
| USD   | 4.326.157        | 26/04/2024       | NZD     | 7.100.000              | Crédit Agricole                     | 79.182   |
| USD   | 4.579.133        | 26/04/2024       | KRW     | 6.100.000.000          | J.P. Morgan Chase Bank, New York    | 49.886   |
| INR   | 1.500.000.000    | 30.04.2024       | USD     | 17.965.470             | BNP Paribas                         | 9.644  |
| IDR   | 143.100.000.000  | 30.04.2024       | USD     | 8.990.936              | UBS, London                         | 16.316   |
| USD   | 211.977          | 30.04.2024       | EUR     | 195.695                | HSBC Bank PLC                       | 381  |
| GBP   | 103.795          | 30.04.2024       | USD     | 131.088                | HSBC Bank PLC                       | 51   |
| GBP   | 5.445            | 30.04.2024       | USD     | 6.877                  | HSBC Bank PLC                       | 2  |
| USD   | 1.799            | 30.04.2024       | GBP     | 1.423                  | HSBC Bank PLC                       | 2  |
| JPY   | 149.373          | 30.04.2024       | USD     | 990                    | HSBC Bank PLC                       | 1  |
| USD   | 7.934            | 30.04.2024       | SGD     | 10.663                 | HSBC Bank PLC                       | 23   |

# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

| Teilfonds                                       | Im Austausch für | Erfüllungstermin | Währung | Kontrakt zur Lieferung | Kontrahent                          | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|---|------------------|------------------|---------|------------------------|-------------------------------------|--|
| <b>Global Short Duration Bond (Fortsetzung)</b> |                  |                  |         |                        |                                     |  |
| USD   | 19               | 30.04.2024       | SGD     | 25                     | HSBC Bank PLC                       | -  |
| USD   | 123.807          | 30.04.2024       | CNH     | 891.912                | HSBC Bank PLC                       | 846  |
| USD   | 96.493           | 30.04.2024       | CNH     | 699.392                | HSBC Bank PLC                       | 73   |
| USD   | 50.242           | 30.04.2024       | AUD     | 76.409                 | HSBC Bank PLC                       | 354  |
| AUD   | 145.522          | 30.04.2024       | USD     | 94.974                 | HSBC Bank PLC                       | 39   |
| USD   | 399.862          | 30.04.2024       | AUD     | 611.196                | HSBC Bank PLC                       | 809  |
| CAD   | 160.077          | 30.04.2024       | USD     | 118.325                | HSBC Bank PLC                       | 15   |
| CAD   | 667.550          | 30.04.2024       | USD     | 491.294                | HSBC Bank PLC                       | 2.203  |
| CAD   | 169.825          | 30.04.2024       | USD     | 125.117                | HSBC Bank PLC                       | 429  |
| CAD   | 130.367          | 30.04.2024       | USD     | 96.112                 | HSBC Bank PLC                       | 264  |
| CAD   | 20.298           | 30.04.2024       | USD     | 14.947                 | HSBC Bank PLC                       | 59   |
| USD   | 104.401.671      | 30.04.2024       | EUR     | 96.350.000             | HSBC, Sheffield                     | 222.626  |
| USD   | 12.459.174       | 30.04.2024       | AUD     | 19.050.000             | J.P. Morgan Chase Bank, New York    | 21.351   |
| USD   | 2.059.447        | 30.04.2024       | EUR     | 1.900.000              | State Street Bank and Trust Company | 5.060  |
|   |                  |                  |         |                        | <b>USD</b>                          | <b>5.125.292</b>   |
| USD   | 10.218.017       | 10/04/2024       | EUR     | 9.480.000              | State Street Bank and Trust Company | (24.076)   |
| USD   | 14.333.418       | 10/04/2024       | AUD     | 22.000.000             | UBS, London                         | (22.255)   |
| USD   | 476.505.773      | 10/04/2024       | EUR     | 443.000.000            | HSBC, Sheffield                     | (2.106.782)  |
| USD   | 4.963.550        | 10/04/2024       | EUR     | 4.600.000              | BNP Paribas                         | (6.241)  |
| USD   | 2.158.592        | 10/04/2024       | EUR     | 2.000.000              | NatWest National Westminster Bank   | (2.187)  |
| USD   | 12.200.950       | 10/04/2024       | EUR     | 11.300.000             | HSBC, Sheffield                     | (7.451)  |
| USD   | 9.758.293        | 10/04/2024       | EUR     | 9.100.000              | State Street Bank and Trust Company | (73.252)   |
| USD   | 5.002.292        | 10/04/2024       | EUR     | 4.650.000              | HSBC, Sheffield                     | (21.519)   |
| EUR   | 4.500.000        | 10/04/2024       | USD     | 4.889.723              | NatWest National Westminster Bank   | (27.970)   |
| EUR   | 14.200.000       | 10/04/2024       | USD     | 15.440.753             | NatWest National Westminster Bank   | (99.222)   |
| USD   | 7.363.463        | 10/04/2024       | CAD     | 10.000.000             | Crédit Agricole                     | (27.021)   |
| EUR   | 3.400.000        | 10/04/2024       | USD     | 3.685.144              | NatWest National Westminster Bank   | (11.820)   |
| USD   | 11.225.676       | 11/04/2024       | GBP     | 8.900.000              | State Street Bank and Trust Company | (17.748)   |
| USD   | 191.198.792      | 11/04/2024       | GBP     | 151.370.000            | Crédit Agricole                     | (27.850)   |
| USD   | 2.396.164        | 11/04/2024       | GBP     | 1.900.000              | HSBC, Sheffield                     | (4.117)  |
| USD   | 9.933.535        | 26/04/2024       | PLN     | 40.000.000             | NatWest National Westminster Bank   | (95.072)   |
| USD   | 16.044.545       | 26/04/2024       | MXN     | 280.000.000            | State Street Bank and Trust Company | (738.252)  |
| CNY   | 70.000.000       | 26/04/2024       | USD     | 9.749.015              | State Street Bank and Trust Company | (7.086)  |
| USD   | 4.206.169        | 26/04/2024       | PLN     | 17.000.000             | Goldman Sachs International, London | (55.989)   |
| USD   | 5.346.566        | 26/04/2024       | MXN     | 92.000.000             | State Street Bank and Trust Company | (167.782)  |
| CZK   | 191.000.000      | 26/04/2024       | USD     | 8.250.946              | HSBC, Sheffield                     | (94.487)   |
| PLN   | 17.000.000       | 26/04/2024       | USD     | 4.335.518              | State Street Bank and Trust Company | (73.360)   |
| AUD   | 27.400.000       | 30.04.2024       | USD     | 18.125.703             | Merrill Lynch International Bank    | (236.130)  |
| JPY   | 5.300.000.000    | 30.04.2024       | USD     | 36.359.792             | Merrill Lynch International Bank    | (1.185.424)  |
| JPY   | 400.000.000      | 30.04.2024       | USD     | 2.721.642              | NatWest National Westminster Bank   | (66.973)   |
| AUD   | 3.400.000        | 30.04.2024       | USD     | 2.225.297              | HSBC, Sheffield                     | (5.423)  |
| JPY   | 310.000.000      | 30.04.2024       | USD     | 2.098.661              | HSBC, Sheffield                     | (41.292)   |
| INR   | 170.000.000      | 30.04.2024       | USD     | 2.041.454              | Citigroup Global Markets Limited    | (4.274)  |
| IDR   | 14.000.000.000   | 30.04.2024       | USD     | 893.864                | HSBC, Sheffield                     | (12.651)   |
| INR   | 40.000.000       | 30.04.2024       | USD     | 480.746                | Goldman Sachs International, London | (1.410)  |
| EUR   | 1.454.575        | 30.04.2024       | USD     | 1.589.813              | HSBC Bank PLC                       | (17.044)   |

# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

| Teilfonds                                       | Im Austausch für | Erfüllungstermin | Währung | Kontrakt zur Lieferung | Kontrahent                               | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|---|------------------|------------------|---------|------------------------|--|--|
| <b>Global Short Duration Bond (Fortsetzung)</b> |                  |                  |         |                        |  |  |
| EUR   | 11.422.471       | 30.04.2024       | USD     | 12.484.463             | HSBC Bank PLC                            | (133.845)  |
| EUR   | 32.494           | 30.04.2024       | USD     | 35.345                 | HSBC Bank PLC                            | (211)  |
| EUR   | 783.932          | 30.04.2024       | USD     | 849.119                | HSBC Bank PLC                            | (1.488)  |
| GBP   | 28.208.599       | 30.04.2024       | USD     | 36.038.742             | HSBC Bank PLC                            | (398.883)  |
| GBP   | 246.012          | 30.04.2024       | USD     | 311.680                | HSBC Bank PLC                            | (858)  |
| USD   | 551.839          | 30.04.2024       | GBP     | 437.841                | HSBC Bank PLC                            | (1.347)  |
| GBP   | 97.009           | 30.04.2024       | USD     | 122.680                | HSBC Bank PLC                            | (115)  |
| GBP   | 488.925          | 30.04.2024       | USD     | 624.640                | HSBC Bank PLC                            | (6.914)  |
| USD   | 6.080            | 30.04.2024       | GBP     | 4.824                  | HSBC Bank PLC                            | (15)   |
| USD   | 18.357           | 30.04.2024       | GBP     | 14.535                 | HSBC Bank PLC                            | (7)  |
| USD   | 9.171            | 30.04.2024       | GBP     | 7.261                  | HSBC Bank PLC                            | (3)  |
| USD   | 5.287            | 30.04.2024       | GBP     | 4.198                  | HSBC Bank PLC                            | (17)   |
| GBP   | 70.443.694       | 30.04.2024       | USD     | 89.997.455             | HSBC Bank PLC                            | (996.108)  |
| SGD   | 896.774          | 30.04.2024       | USD     | 670.916                | HSBC Bank PLC                            | (5.576)  |
| SGD   | 14.138           | 30.04.2024       | USD     | 10.538                 | HSBC Bank PLC                            | (48)   |
| USD   | 13               | 30.04.2024       | SGD     | 18                     | HSBC Bank PLC                            | -  |
| CNH   | 751.337.830      | 30.04.2024       | USD     | 104.475.104            | HSBC Bank PLC                            | (893.815)  |
| USD   | 35.533           | 30.04.2024       | CNH     | 257.878                | HSBC Bank PLC                            | (19)   |
| CNH   | 7.751.498        | 30.04.2024       | USD     | 1.071.371              | HSBC Bank PLC                            | (2.731)  |
| CNH   | 728.504          | 30.04.2024       | USD     | 100.677                | HSBC Bank PLC                            | (244)  |
| AUD   | 176.337.432      | 30.04.2024       | USD     | 116.664.316            | HSBC Bank PLC                            | (1.532.883)  |
| AUD   | 1.620.809        | 30.04.2024       | USD     | 1.060.602              | HSBC Bank PLC                            | (2.369)  |
| AUD   | 5.506.306        | 30.04.2024       | USD     | 3.595.117              | HSBC Bank PLC                            | (27)   |
| CAD   | 49.929.889       | 30.04.2024       | USD     | 37.042.780             | HSBC Bank PLC                            | (131.354)  |
| USD   | 52.890.788       | 30.04.2024       | GBP     | 41.869.000             | HSBC, Sheffield                          | (8.162)  |
| USD   | 7.033.000        | 06/06/2024       | EUR     | 6.500.000              | UBS, London                              | (5.185)  |
| <b>USD</b>                                      |                  |                  |         |                        |  | <b>(9.404.384)</b>   |
| <b>India Fixed Income</b>                       |                  |                  |         |                        |  |  |
| INR   | 4.556.201.498    | 30.04.2024       | USD     | 54.590.000             | HSBC Bank PLC                            | 8.831  |
| USD   | 4.290.000        | 30.04.2024       | INR     | 356.018.949            | State Street Bank and Trust Co, Hongkong | 23.679   |
| USD   | 7.620.000        | 30.04.2024       | INR     | 632.015.754            | Citigroup Global Markets Limited         | 46.296   |
| USD   | 2.160.000        | 30.04.2024       | INR     | 179.783.496            | Merrill Lynch International Bank         | 5.581  |
| USD   | 4.510.000        | 30.04.2024       | INR     | 376.350.480            | HSBC Bank PLC                            | 38   |
| USD   | 7.447            | 30.04.2024       | EUR     | 6.867                  | HSBC Bank PLC                            | 22   |
| USD   | 63.847           | 30.04.2024       | EUR     | 58.943                 | HSBC Bank PLC                            | 115  |
| JPY   | 149.504          | 30.04.2024       | USD     | 991                    | HSBC Bank PLC                            | 1  |
| USD   | 138.263          | 30.04.2024       | SGD     | 185.500                | HSBC Bank PLC                            | 636  |
| USD   | 1.100            | 30.04.2024       | SGD     | 1.482                  | HSBC Bank PLC                            | -  |
| USD   | 11.583           | 30.04.2024       | CNH     | 83.445                 | HSBC Bank PLC                            | 79   |
| CAD   | 4.204            | 30.04.2024       | USD     | 3.107                  | HSBC Bank PLC                            | -  |
| USD   | 6.700.000        | 31/05/2024       | INR     | 555.758.300            | Westpac Banking Sydney                   | 46.164   |
| <b>USD</b>                                      |                  |                  |         |                        |  | <b>131.442</b>   |

# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

| Teilfonds                               | Im Austausch für | Erfüllungstermin | Währung | Kontrakt zur Lieferung | Kontrahent                       | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|---|------------------|------------------|---------|------------------------|----------------------------------|--|
| <b>India Fixed Income (Fortsetzung)</b> |                  |                  |         |                        |                                  |  |
| INR                                     | 402.555.867      | 30.04.2024       | USD     | 4.830.000              | HSBC Bank PLC                    | (6.008)  |
| INR                                     | 709.384.239      | 30.04.2024       | USD     | 8.510.000              | Crédit Agricole                  | (9.157)  |
| INR                                     | 429.730.476      | 30.04.2024       | USD     | 5.160.000              | Crédit Agricole                  | (10.363)   |
| EUR                                     | 8.694.921        | 30.04.2024       | USD     | 9.503.322              | HSBC Bank PLC                    | (101.884)  |
| EUR                                     | 2.499            | 30.04.2024       | USD     | 2.718                  | HSBC Bank PLC                    | (16)   |
| EUR                                     | 49.610           | 30.04.2024       | USD     | 53.738                 | HSBC Bank PLC                    | (97)   |
| USD                                     | 48.681           | 30.04.2024       | EUR     | 45.132                 | HSBC Bank PLC                    | (118)  |
| EUR                                     | 1.846.409        | 30.04.2024       | USD     | 2.018.077              | HSBC Bank PLC                    | (21.636)   |
| EUR                                     | 42.743           | 30.04.2024       | USD     | 46.493                 | HSBC Bank PLC                    | (278)  |
| EUR                                     | 15.683           | 30.04.2024       | USD     | 16.988                 | HSBC Bank PLC                    | (30)   |
| GBP                                     | 7.056.014        | 30.04.2024       | USD     | 9.014.622              | HSBC Bank PLC                    | (99.775)   |
| USD                                     | 52.820           | 30.04.2024       | GBP     | 41.937                 | HSBC Bank PLC                    | (165)  |
| SGD                                     | 12.299.219       | 30.04.2024       | USD     | 9.201.594              | HSBC Bank PLC                    | (76.466)   |
| SGD                                     | 92.207           | 30.04.2024       | USD     | 68.603                 | HSBC Bank PLC                    | (192)  |
| SGD                                     | 1.833            | 30.04.2024       | USD     | 1.361                  | HSBC Bank PLC                    | (1)  |
| USD                                     | 45.658           | 30.04.2024       | SGD     | 61.614                 | HSBC Bank PLC                    | (55)   |
| CNH                                     | 306.734.128      | 30.04.2024       | USD     | 42.652.025             | HSBC Bank PLC                    | (364.901)  |
| CNH                                     | 146.026          | 30.04.2024       | USD     | 20.180                 | HSBC Bank PLC                    | (49)   |
| USD                                     | 237.361          | 30.04.2024       | CNH     | 1.722.926              | HSBC Bank PLC                    | (166)  |
| AUD                                     | 44.138.469       | 30.04.2024       | USD     | 29.201.879             | HSBC Bank PLC                    | (383.691)  |
| AUD                                     | 12.780           | 30.04.2024       | USD     | 8.403                  | HSBC Bank PLC                    | (59)   |
| USD                                     | 123.027          | 30.04.2024       | AUD     | 188.506                | HSBC Bank PLC                    | (50)   |
| AUD                                     | 150              | 30.04.2024       | USD     | 98                     | HSBC Bank PLC                    | -  |
| USD                                     | 157.177          | 30.04.2024       | AUD     | 242.076                | HSBC Bank PLC                    | (876)  |
| CAD                                     | 3.662.077        | 30.04.2024       | USD     | 2.716.880              | HSBC Bank PLC                    | (9.634)  |
| USD                                     | 15.517           | 30.04.2024       | CAD     | 21.115                 | HSBC Bank PLC                    | (93)   |
| INR                                     | 1.274.864.850    | 31/05/2024       | USD     | 15.300.000             | UBS                              | (36.636)   |
| INR                                     | 244.680.618      | 31/05/2024       | USD     | 2.940.000              | Citigroup Global Markets Limited | (10.553)   |
| INR                                     | 633.088.076      | 31/05/2024       | USD     | 7.610.000              | BNP Paribas                      | (30.331)   |
| INR                                     | 99.831.480       | 31/05/2024       | USD     | 1.200.000              | Crédit Agricole                  | (4.764)  |
| INR                                     | 360.855.376      | 31/05/2024       | USD     | 4.340.000              | BNP Paribas                      | (19.646)   |
| INR                                     | 396.434.080      | 31/05/2024       | USD     | 4.780.000              | Westpac Banking Sydney           | (33.679)   |
| INR                                     | 866.403.412      | 31/05/2024       | USD     | 10.430.000             | BNP Paribas                      | (56.955)   |
| INR                                     | 568.099.180      | 31/05/2024       | USD     | 6.820.000              | BNP Paribas                      | (18.413)   |
| INR                                     | 583.567.140      | 31/05/2024       | USD     | 6.990.000              | Westpac Banking Sydney           | (3.222)  |
|   |                  |                  |         |                        | <b>USD</b>                       | <b>(1.299.959)</b>   |
| <b>RMB Fixed Income</b>                 |                  |                  |         |                        |                                  |  |
| USD                                     | 1.768            | 30.04.2024       | EUR     | 1.632                  | HSBC Bank PLC                    | 3  |
| USD                                     | 4.597            | 30.04.2024       | EUR     | 4.244                  | HSBC Bank PLC                    | 9  |
| USD                                     | 14.063           | 30.04.2024       | EUR     | 12.983                 | HSBC Bank PLC                    | 25   |

# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

| Teilfonds                             | Im Austausch für | Erfüllungstermin | Währung | Kontrakt zur Lieferung | Kontrahent                               | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|---------------------------------------|------------------|------------------|---------|------------------------|--|--|
| <b>RMB Fixed Income (Fortsetzung)</b> |                  |                  |         |                        |  |  |
| USD                                   | 28.832           | 30.04.2024       | EUR     | 26.614                 | HSBC Bank PLC                            | 55   |
| USD                                   | 13.738           | 30.04.2024       | EUR     | 12.682                 | HSBC Bank PLC                            | 25   |
| USD                                   | 7.039            | 30.04.2024       | EUR     | 6.471                  | HSBC Bank PLC                            | 42   |
| USD                                   | 131.186          | 30.04.2024       | EUR     | 121.095                | HSBC Bank PLC                            | 251  |
| USD                                   | 10.040           | 30.04.2024       | EUR     | 9.258                  | HSBC Bank PLC                            | 29   |
| USD                                   | 3.055.972        | 30.04.2024       | EUR     | 2.821.239              | HSBC Bank PLC                            | 5.489  |
| USD                                   | 416              | 30.04.2024       | SGD     | 560                    | HSBC Bank PLC                            | 1  |
| USD                                   | 3.668            | 30.04.2024       | SGD     | 4.922                  | HSBC Bank PLC                            | 17   |
| USD                                   | 97               | 30.04.2024       | SGD     | 130                    | HSBC Bank PLC                            | -  |
| USD                                   | 30.794           | 30.04.2024       | SGD     | 41.400                 | HSBC Bank PLC                            | 78   |
| USD                                   | 3.199            | 30.04.2024       | SGD     | 4.299                  | HSBC Bank PLC                            | 9  |
| USD                                   | 84               | 30.04.2024       | SGD     | 113                    | HSBC Bank PLC                            | -  |
| USD                                   | 15               | 30.04.2024       | SGD     | 20                     | HSBC Bank PLC                            | -  |
| USD                                   | 18.359           | 30.04.2024       | EUR     | 16.947                 | HSBC Bank PLC                            | 35   |
| CNY                                   | 1.753.464        | 28/06/2024       | USD     | 245.000                | State Street Bank and Trust Co, Hongkong | 103  |
| CNY                                   | 49.382.307       | 28/06/2024       | USD     | 6.900.000              | State Street Bank and Trust Co, Hongkong | 2.755  |
| CNY                                   | 17.539.665       | 28/06/2024       | USD     | 2.450.000              | HSBC Bank PLC                            | 1.728  |
| USD                                   | 1.640.000        | 28/06/2024       | CNY     | 11.700.377             | Westpac Banking Sydney                   | 4.499  |
| CNY                                   | 1.610.326        | 28/06/2024       | USD     | 223.500                | State Street Bank and Trust Co, Hongkong | 1.595  |
| CNY                                   | 965.415          | 28/06/2024       | USD     | 134.000                | UBS                                      | 948  |
| CNY                                   | 1.448.760        | 28/06/2024       | USD     | 201.000                | State Street Bank and Trust Co, Hongkong | 1.510  |
|                                       |                  |                  |         |                        | <b>USD</b>                               | <b>19.206</b>  |
| EUR                                   | 549.034          | 30.04.2024       | USD     | 600.080                | HSBC Bank PLC                            | (6.433)  |
| EUR                                   | 3.436.252        | 30.04.2024       | USD     | 3.755.734              | HSBC Bank PLC                            | (40.265)   |
| EUR                                   | 15.717.667       | 30.04.2024       | USD     | 17.179.001             | HSBC Bank PLC                            | (184.175)  |
| EUR                                   | 927              | 30.04.2024       | USD     | 1.005                  | HSBC Bank PLC                            | (2)  |
| EUR                                   | 6.002            | 30.04.2024       | USD     | 6.514                  | HSBC Bank PLC                            | (24)   |
| SGD                                   | 70.970           | 30.04.2024       | USD     | 53.096                 | HSBC Bank PLC                            | (441)  |
| SGD                                   | 5.242.956        | 30.04.2024       | USD     | 3.922.489              | HSBC Bank PLC                            | (32.596)   |
| EUR                                   | 2.200.025        | 30.04.2024       | USD     | 2.404.570              | HSBC Bank PLC                            | (25.779)   |
| CNY                                   | 1.093.391        | 28/06/2024       | USD     | 153.000                | HSBC Bank PLC                            | (164)  |
| CNY                                   | 19.295.083       | 28/06/2024       | USD     | 2.700.000              | HSBC Bank PLC                            | (2.896)  |
| CNY                                   | 4.995.775        | 28/06/2024       | USD     | 700.000                | State Street Bank and Trust Co, Hongkong | (1.681)  |
| CNY                                   | 4.431.386        | 28/06/2024       | USD     | 622.000                | HSBC Bank PLC                            | (2.572)  |
| CNY                                   | 101.237.937      | 28/06/2024       | USD     | 14.210.000             | HSBC Bank PLC                            | (58.765)   |
| USD                                   | 250.000          | 28/06/2024       | CNY     | 1.788.849              | HSBC Bank PLC                            | (49)   |
| USD                                   | 5.000.000        | 28/06/2024       | CNY     | 35.794.410             | Crédit Agricole                          | (3.412)  |
| USD                                   | 787.000          | 28/06/2024       | CNY     | 5.670.653              | UBS                                      | (5.655)  |
| USD                                   | 735.000          | 28/06/2024       | CNY     | 5.305.992              | UBS                                      | (6.682)  |
|                                       |                  |                  |         |                        | <b>USD</b>                               | <b>(371.591)</b>   |

# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

| Teilfonds                           | Im Austausch für | Erfüllungstermin | Währung | Kontrakt zur Lieferung | Kontrahent                       | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|-------------------------------------|------------------|------------------|---------|------------------------|----------------------------------|--|
| <b>Singapore Dollar Income Bond</b> |                  |                  |         |                        |                                  |  |
| USD                                 | 1.950.000        | 30.04.2024       | SGD     | 2.614.827              | Crédit Agricole                  | 13.464   |
| USD                                 | 42.910.808       | 30.04.2024       | SGD     | 57.370.034             | HSBC Bank PLC                    | 466.939  |
| USD                                 | 48.935           | 30.04.2024       | SGD     | 65.654                 | HSBC Bank PLC                    | 303  |
| USD                                 | 108.680          | 30.04.2024       | SGD     | 146.072                | HSBC Bank PLC                    | 411  |
| AUD                                 | 992              | 30.04.2024       | SGD     | 872                    | HSBC Bank PLC                    | 1  |
|                                     |                  |                  |         |                        | <b>SGD</b>                       | <b>481.118</b>   |
| SGD                                 | 125.660.227      | 30.04.2024       | USD     | 93.700.000             | Crédit Agricole                  | (632.534)  |
| SGD                                 | 4.835.368        | 30.04.2024       | USD     | 3.600.000              | BNP Paribas                      | (16.861)   |
| SGD                                 | 2.123.357        | 30.04.2024       | USD     | 1.600.000              | Crédit Agricole                  | (33.190)   |
| SGD                                 | 803.679          | 30.04.2024       | USD     | 600.000                | BNP Paribas                      | (5.026)  |
| SGD                                 | 2.419.468        | 30.04.2024       | USD     | 1.800.000              | HSBC Bank PLC                    | (6.646)  |
| SGD                                 | 1.751.677        | 30.04.2024       | USD     | 1.300.000              | UBS                              | (517)  |
| SGD                                 | 141.515          | 30.04.2024       | USD     | 105.051                | HSBC Bank PLC                    | (77)   |
| SGD                                 | 46.188           | 30.04.2024       | USD     | 34.371                 | HSBC Bank PLC                    | (138)  |
| SGD                                 | 17.418           | 30.04.2024       | USD     | 12.937                 | HSBC Bank PLC                    | (19)   |
| AUD                                 | 3.577.789        | 30.04.2024       | SGD     | 3.165.013              | HSBC Bank PLC                    | (16.373)   |
| AUD                                 | 8.537.905        | 30.04.2024       | SGD     | 7.552.870              | HSBC Bank PLC                    | (39.071)   |
|                                     |                  |                  |         |                        | <b>SGD</b>                       | <b>(750.452)</b>   |
| <b>Ultra Short Duration Bond</b>    |                  |                  |         |                        |                                  |  |
| USD                                 | 10.210.754       | 03/04/2024       | EUR     | 9.416.618              | Standard Chartered Bank, London  | 39.993   |
| USD                                 | 3.160.682        | 03/04/2024       | GBP     | 2.500.000              | BNP Paribas                      | 2.558  |
| USD                                 | 5.748            | 30.04.2024       | EUR     | 5.285                  | HSBC Bank PLC                    | 34   |
| USD                                 | 1.289            | 30.04.2024       | EUR     | 1.188                  | HSBC Bank PLC                    | 5  |
| USD                                 | 3.197            | 30.04.2024       | EUR     | 2.948                  | HSBC Bank PLC                    | 9  |
| USD                                 | 2.980            | 30.04.2024       | EUR     | 2.751                  | HSBC Bank PLC                    | 5  |
| GBP                                 | 16.211           | 30.04.2024       | USD     | 20.476                 | HSBC Bank PLC                    | 6  |
| CNH                                 | 177.525          | 30.04.2024       | USD     | 24.461                 | HSBC Bank PLC                    | 13   |
| AUD                                 | 1.743.765        | 30.04.2024       | USD     | 1.138.049              | HSBC Bank PLC                    | 462  |
| USD                                 | 10               | 30.04.2024       | EUR     | 9                      | HSBC Bank PLC                    | -  |
|                                     |                  |                  |         |                        | <b>USD</b>                       | <b>43.085</b>  |
| GBP                                 | 2.250.000        | 03/04/2024       | USD     | 2.851.719              | Standard Chartered Bank, London  | (9.407)  |
| GBP                                 | 200.000          | 03/04/2024       | USD     | 254.119                | Merrill Lynch International Bank | (1.469)  |
| EUR                                 | 200.000          | 03/04/2024       | USD     | 217.079                | BNP Paribas                      | (1.061)  |
| EUR                                 | 7.801.136        | 30.04.2024       | USD     | 8.526.439              | HSBC Bank PLC                    | (91.411)   |
| EUR                                 | 3.407            | 30.04.2024       | USD     | 3.690                  | HSBC Bank PLC                    | (6)  |
| GBP                                 | 8.265.620        | 30.04.2024       | USD     | 10.559.990             | HSBC Bank PLC                    | (116.880)  |
| GBP                                 | 278.650          | 30.04.2024       | USD     | 353.030                | HSBC Bank PLC                    | (972)  |
| USD                                 | 821              | 30.04.2024       | GBP     | 651                    | HSBC Bank PLC                    | (2)  |
| GBP                                 | 9.907            | 30.04.2024       | USD     | 12.529                 | HSBC Bank PLC                    | (12)   |
| USD                                 | 6.820            | 30.04.2024       | GBP     | 5.400                  | HSBC Bank PLC                    | (3)  |
| GBP                                 | 17.843.243       | 30.04.2024       | USD     | 22.796.171             | HSBC Bank PLC                    | (252.312)  |
| GBP                                 | 39.176.607       | 30.04.2024       | USD     | 50.051.250             | HSBC Bank PLC                    | (553.976)  |
| GBP                                 | 4.614.513        | 30.04.2024       | USD     | 5.895.410              | HSBC Bank PLC                    | (65.250)   |
| SGD                                 | 27.373.638       | 30.04.2024       | USD     | 20.479.440             | HSBC Bank PLC                    | (170.186)  |
| SGD                                 | 197.000          | 30.04.2024       | USD     | 146.211                | HSBC Bank PLC                    | (51)   |

# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

| Teilfonds                                      | Im Austausch für | Erfüllungstermin | Währung | Kontrakt zur Lieferung | Kontrahent                      | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|--|------------------|------------------|---------|------------------------|---------------------------------|--|
| <b>Ultra Short Duration Bond (Fortsetzung)</b> |                  |                  |         |                        |                                 |  |
| SGD  | 1.172.774        | 30.04.2024       | USD     | 872.600                | HSBC Bank PLC                   | (2.487)  |
| SGD  | 24.625           | 30.04.2024       | USD     | 18.321                 | HSBC Bank PLC                   | (51)   |
| SGD  | 104.681          | 30.04.2024       | USD     | 77.734                 | HSBC Bank PLC                   | (68)   |
| CNH  | 65.390.628       | 30.04.2024       | USD     | 9.092.704              | HSBC Bank PLC                   | (77.791)   |
| CNH  | 134.656          | 30.04.2024       | USD     | 18.692                 | HSBC Bank PLC                   | (128)  |
| CNH  | 237.776          | 30.04.2024       | USD     | 32.864                 | HSBC Bank PLC                   | (84)   |
| CNH  | 151.250          | 30.04.2024       | USD     | 20.902                 | HSBC Bank PLC                   | (51)   |
| CNH  | 10.000           | 30.04.2024       | USD     | 1.380                  | HSBC Bank PLC                   | (1)  |
| CNH  | 28.078.807       | 30.04.2024       | USD     | 3.904.417              | HSBC Bank PLC                   | (33.403)   |
| CNH  | 99.970           | 30.04.2024       | USD     | 13.877                 | HSBC Bank PLC                   | (95)   |
| USD  | 198.767          | 30.04.2024       | CNH     | 1.442.531              | HSBC Bank PLC                   | (104)  |
| AUD  | 24.785.124       | 30.04.2024       | USD     | 16.397.764             | HSBC Bank PLC                   | (215.455)  |
| AUD  | 336.616          | 30.04.2024       | USD     | 221.339                | HSBC Bank PLC                   | (1.561)  |
| AUD  | 192.803          | 30.04.2024       | USD     | 126.164                | HSBC Bank PLC                   | (282)  |
| AUD  | 336.561          | 30.04.2024       | USD     | 220.188                | HSBC Bank PLC                   | (446)  |
| AUD  | 1.223.177        | 30.04.2024       | USD     | 798.623                | HSBC Bank PLC                   | (6)  |
| AUD  | 16.124.809       | 30.04.2024       | USD     | 10.668.125             | HSBC Bank PLC                   | (140.171)  |
| EUR  | 113.398          | 30.04.2024       | USD     | 123.941                | HSBC Bank PLC                   | (1.329)  |
| USD  | 63.116           | 03/05/2024       | GBP     | 50.000                 | Standard Chartered Bank, London | (57)   |
| USD  | 9.958.228        | 03/05/2024       | EUR     | 9.216.618              | BNP Paribas                     | (8.451)  |
| <b>USD</b>                                     |                  |                  |         |                        |                                 | <b>(1.745.019)</b>   |
| <b>US Dollar Bond</b>                          |                  |                  |         |                        |                                 |  |
| GBP  | 17.194           | 30.04.2024       | USD     | 21.696                 | HSBC Bank PLC                   | 28   |
| CAD  | 267.624          | 30.04.2024       | USD     | 197.821                | HSBC Bank PLC                   | 24   |
| <b>USD</b>                                     |                  |                  |         |                        |                                 | <b>52</b>  |
| EUR  | 1.091.324        | 30.04.2024       | USD     | 1.192.789              | HSBC Bank PLC                   | (12.788)   |
| GBP  | 3.412.852        | 30.04.2024       | USD     | 4.360.191              | HSBC Bank PLC                   | (48.259)   |
| CAD  | 6.245.799        | 30.04.2024       | USD     | 4.633.733              | HSBC Bank PLC                   | (16.431)   |
| <b>USD</b>                                     |                  |                  |         |                        |                                 | <b>(77.478)</b>  |
| <b>US High Yield Bond</b>                      |                  |                  |         |                        |                                 |  |
| AUD  | 59.945           | 30.04.2024       | USD     | 39.123                 | HSBC Bank PLC                   | 16   |
| <b>USD</b>                                     |                  |                  |         |                        |                                 | <b>16</b>  |
| CNH  | 24.878.268       | 30.04.2024       | USD     | 3.459.375              | HSBC Bank PLC                   | (29.596)   |
| AUD  | 378.887          | 30.04.2024       | USD     | 250.670                | HSBC Bank PLC                   | (3.294)  |
| <b>USD</b>                                     |                  |                  |         |                        |                                 | <b>(32.890)</b>  |

# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

| Teilfonds   | Im Austausch für | Erfüllungstermin | Währung | Kontrakt zur Lieferung | Kontrahent                          | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|---|------------------|------------------|---------|------------------------|-------------------------------------|--|
| <b>US Short Duration High Yield Bond*</b>         |                  |                  |         |                        |                                     |  |
| USD   | 215.644          | 30.04.2024       | EUR     | 199.089                | HSBC Bank PLC                       | 378  |
| USD   | 2.086            | 30.04.2024       | EUR     | 1.918                  | HSBC Bank PLC                       | 12   |
| USD   | 914              | 30.04.2024       | EUR     | 844                    | HSBC Bank PLC                       | 2  |
| USD   | 53               | 30.04.2024       | EUR     | 49                     | HSBC Bank PLC                       | -  |
| USD   | 10.972.440       | 15/05/2024       | EUR     | 10.000.000             | Crédit Agricole                     | 153.721  |
|   |                  |                  |         |                        | <b>USD</b>                          | <b>154.113</b>   |
| USD   | 12.652.585       | 04/04/2024       | EUR     | 11.800.000             | Crédit Agricole                     | (92.946)   |
| EUR   | 300.000          | 04/04/2024       | USD     | 328.881                | BNP Paribas                         | (4.842)  |
| EUR   | 3.267.555        | 30.04.2024       | USD     | 3.571.353              | HSBC Bank PLC                       | (38.289)   |
| EUR   | 17.500           | 30.04.2024       | USD     | 19.036                 | HSBC Bank PLC                       | (114)  |
| EUR   | 2.000            | 30.04.2024       | USD     | 2.169                  | HSBC Bank PLC                       | (6)  |
| EUR   | 3.064.033        | 30.04.2024       | USD     | 3.348.908              | HSBC Bank PLC                       | (35.903)   |
| EUR   | 23.387           | 30.04.2024       | USD     | 25.333                 | HSBC Bank PLC                       | (46)   |
| EUR   | 1.872.166        | 30.04.2024       | USD     | 2.046.229              | HSBC Bank PLC                       | (21.937)   |
| EUR   | 2.105.605        | 30.04.2024       | USD     | 2.301.372              | HSBC Bank PLC                       | (24.674)   |
| EUR   | 12.683.613       | 30.04.2024       | USD     | 13.862.859             | HSBC Bank PLC                       | (148.623)  |
| EUR   | 357.988          | 30.04.2024       | USD     | 387.756                | HSBC Bank PLC                       | (679)  |
| EUR   | 1.738            | 30.04.2024       | USD     | 1.885                  | HSBC Bank PLC                       | (5)  |
| USD   | 227.546          | 30.04.2024       | EUR     | 210.956                | HSBC Bank PLC                       | (551)  |
| GBP   | 231.582          | 30.04.2024       | USD     | 295.865                | HSBC Bank PLC                       | (3.275)  |
| USD   | 4.621            | 30.04.2024       | GBP     | 3.669                  | HSBC Bank PLC                       | (14)   |
| CHF   | 228.140          | 30.04.2024       | USD     | 256.041                | HSBC Bank PLC                       | (1.991)  |
| USD   | 4.476            | 30.04.2024       | CHF     | 4.045                  | HSBC Bank PLC                       | (28)   |
| SGD   | 33.142           | 30.04.2024       | USD     | 24.795                 | HSBC Bank PLC                       | (206)  |
| USD   | 402              | 30.04.2024       | SGD     | 542                    | HSBC Bank PLC                       | -  |
| EUR   | 400.000          | 15/05/2024       | USD     | 436.435                | BNP Paribas                         | (3.686)  |
| EUR   | 200.000          | 15/05/2024       | USD     | 218.318                | BNP Paribas                         | (1.944)  |
|   |                  |                  |         |                        | <b>USD</b>                          | <b>(379.759)</b>   |
| <b>Global Emerging Markets Multi-Asset Income</b> |                  |                  |         |                        |                                     |  |
| USD   | 542.474          | 02/04/2024       | BRL     | 2.700.000              | BNP Paribas                         | 3.072  |
| USD   | 20.014           | 02/04/2024       | BRL     | 100.000                | Barclays Bank, London               | 36   |
| USD   | 10.017           | 02/04/2024       | BRL     | 50.000                 | Citibank, New York                  | 29   |
| USD   | 497.213          | 02/04/2024       | BRL     | 2.480.000              | Citibank, New York                  | 1.762  |
| USD   | 18.000           | 02/04/2024       | BRL     | 89.992                 | Deutsche Bank, London               | 22   |
| EGP   | 476.000          | 02/04/2024       | USD     | 10.000                 | J.P. Morgan Chase Bank, New York    | 40   |
| USD   | 20.000           | 05/04/2024       | MYR     | 92.407                 | Morgan Stanley, London              | 495  |
| USD   | 30.000           | 05/04/2024       | MYR     | 137.685                | Barclays Bank, London               | 937  |
| USD   | 45.000           | 05/04/2024       | MYR     | 207.635                | Barclays Bank, London               | 1.171  |
| USD   | 10.000           | 05/04/2024       | MYR     | 46.198                 | Barclays Bank, London               | 248  |
| USD   | 10.000           | 05/04/2024       | MYR     | 47.285                 | Barclays Bank, London               | 19   |
| USD   | 60.000           | 05/04/2024       | MYR     | 284.163                | Goldman Sachs International, London | 19   |
| USD   | 338.558          | 05/04/2024       | MYR     | 1.581.743              | Morgan Stanley, London              | 4.682  |
| USD   | 20.000           | 17/04/2024       | EGP     | 787.000                | Standard Chartered Bank, London     | 3.453  |
| USD   | 28.742           | 17/04/2024       | EGP     | 1.131.000              | Standard Chartered Bank, London     | 4.963  |

\*Bis zum 2. Juli 2023 lautete der Name des Teilfonds Global Short Duration High Yield Bond.



# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

| Teilfonds   | Im Austausch für | Erfüllungstermin | Währung | Kontrakt zur Lieferung | Kontrahent                          | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|---|------------------|------------------|---------|------------------------|-------------------------------------|--|
| <b>Global Emerging Markets Multi-Asset Income (Fortsetzung)</b> |                  |                  |         |                        |                                     |  |
| USD   | 40.000           | 24/04/2024       | THB     | 1.371.376              | Standard Chartered Bank, London     | 2.348  |
| USD   | 26.000           | 24/04/2024       | THB     | 938.244                | Standard Chartered Bank, London     | 240  |
| USD   | 10.000           | 24/04/2024       | THB     | 359.560                | Standard Chartered Bank, London     | 128  |
| USD   | 10.000           | 24/04/2024       | THB     | 357.902                | Standard Chartered Bank, London     | 174  |
| USD   | 50.000           | 24/04/2024       | THB     | 1.789.625              | Standard Chartered Bank, London     | 865  |
| USD   | 10.000           | 24/04/2024       | THB     | 354.200                | Standard Chartered Bank, London     | 275  |
| USD   | 10.000           | 24/04/2024       | THB     | 353.157                | Standard Chartered Bank, London     | 304  |
| USD   | 10.000           | 24/04/2024       | THB     | 360.362                | Standard Chartered Bank, London     | 106  |
| USD   | 911.804          | 24/04/2024       | THB     | 32.929.814             | Standard Chartered Bank, London     | 7.700  |
| USD   | 10.000           | 25/04/2024       | PLN     | 39.790                 | Barclays Bank, London               | 24   |
| PLN   | 79.781           | 25/04/2024       | USD     | 20.000                 | Merrill Lynch International Bank    | 3  |
| PLN   | 39.953           | 25/04/2024       | USD     | 10.000                 | Goldman Sachs International, London | 17   |
| USD   | 10.000           | 25/04/2024       | PLN     | 39.278                 | UBS, London                         | 152  |
| USD   | 10.000           | 25/04/2024       | PLN     | 39.787                 | Merrill Lynch International Bank    | 25   |
| USD   | 565.055          | 25/04/2024       | PLN     | 2.247.699              | Barclays Bank, London               | 1.518  |
| USD   | 20.000           | 26/04/2024       | HUF     | 7.298.395              | Deutsche Bank, London               | 28   |
| USD   | 20.000           | 26/04/2024       | HUF     | 7.299.774              | Barclays Bank, London               | 25   |
| USD   | 10.000           | 26/04/2024       | HUF     | 3.627.236              | J.P. Morgan Chase Bank, New York    | 74   |
| USD   | 10.000           | 26/04/2024       | HUF     | 3.632.015              | Barclays Bank, London               | 61   |
| HUF   | 3.669.577        | 26/04/2024       | USD     | 10.000                 | Deutsche Bank, London               | 42   |
| HUF   | 3.674.147        | 26/04/2024       | USD     | 10.000                 | Deutsche Bank, London               | 54   |
| USD   | 290.281          | 26/04/2024       | HUF     | 105.995.447            | Merrill Lynch International Bank    | 230  |
| GBP   | 13.873           | 30.04.2024       | USD     | 17.464                 | HSBC Bank PLC                       | 63   |
| USD   | 9                | 30.04.2024       | SGD     | 12                     | HSBC Bank PLC                       | -  |
| CNH   | 19.477           | 30.04.2024       | USD     | 2.684                  | HSBC Bank PLC                       | 1  |
| AUD   | 20.487           | 30.04.2024       | USD     | 13.359                 | HSBC Bank PLC                       | 17   |
| AUD   | 35.364           | 30.04.2024       | USD     | 23.080                 | HSBC Bank PLC                       | 9  |
| USD   | 40.000           | 03/05/2024       | BRL     | 197.547                | UBS, London                         | 655  |
| USD   | 10.000           | 03/05/2024       | BRL     | 49.977                 | Goldman Sachs International, London | 46   |
| USD   | 15.000           | 03/05/2024       | BRL     | 74.730                 | Citibank, New York                  | 116  |
| USD   | 18.020           | 03/05/2024       | BRL     | 89.992                 | Citibank, New York                  | 97   |
| USD   | 10.000           | 03/05/2024       | BRL     | 49.867                 | Citibank, New York                  | 68   |
| USD   | 50.000           | 03/05/2024       | BRL     | 249.010                | UBS, London                         | 406  |
| USD   | 15.000           | 03/05/2024       | BRL     | 74.401                 | Standard Chartered Bank, London     | 182  |
| USD   | 10.000           | 03/05/2024       | BRL     | 49.956                 | Deutsche Bank, London               | 51   |
| USD   | 110.000          | 03/05/2024       | BRL     | 550.165                | Citibank, New York                  | 426  |
| USD   | 377.798          | 03/05/2024       | BRL     | 1.889.606              | Barclays Bank, London               | 1.455  |
| USD   | 15.000           | 09/05/2024       | PHP     | 841.470                | Barclays Bank, London               | 37   |
| USD   | 10.000           | 09/05/2024       | PHP     | 558.020                | Barclays Bank, London               | 77   |
| USD   | 100.000          | 10/05/2024       | CLP     | 97.600.000             | Merrill Lynch International Bank    | 609  |
| USD   | 110.000          | 10/05/2024       | CLP     | 107.844.000            | Merrill Lynch International Bank    | 177  |
| USD   | 100.000          | 10/05/2024       | CLP     | 97.571.000             | Standard Chartered Bank, London     | 639  |
| USD   | 130.000          | 10/05/2024       | CLP     | 127.270.000            | Standard Chartered Bank, London     | 395  |

# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

| Teilfonds   | Im Austausch für | Erfüllungstermin | Währung | Kontrakt zur Lieferung | Kontrahent                          | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|---|------------------|------------------|---------|------------------------|-------------------------------------|--|
| <b>Global Emerging Markets Multi-Asset Income (Fortsetzung)</b> |                  |                  |         |                        |                                     |  |
| CLP   | 9.822.402        | 10/05/2024       | USD     | 10.000                 | Goldman Sachs International, London | 3  |
| CLP   | 209.296.883      | 10/05/2024       | USD     | 212.296                | Goldman Sachs International, London | 841  |
| RSD   | 1.084.641        | 13/05/2024       | USD     | 10.000                 | BNP Paribas                         | 3  |
| INR   | 76.954.592       | 14/05/2024       | USD     | 920.219                | Standard Chartered Bank, London     | 1.592  |
| USD   | 10.000           | 14/05/2024       | INR     | 831.260                | Goldman Sachs International, London | 43   |
| USD   | 30.000           | 14/05/2024       | INR     | 2.492.340              | Deutsche Bank, London               | 145  |
| USD   | 10.000           | 14/05/2024       | INR     | 828.270                | Deutsche Bank, London               | 78   |
| USD   | 10.000           | 14/05/2024       | INR     | 828.770                | Morgan Stanley, London              | 72   |
| USD   | 10.000           | 14/05/2024       | INR     | 831.630                | Deutsche Bank, London               | 38   |
| USD   | 20.000           | 16/05/2024       | RON     | 91.854                 | Merrill Lynch International Bank    | 52   |
| USD   | 30.000           | 20/05/2024       | KRW     | 39.891.000             | Barclays Bank, London               | 356  |
| USD   | 30.000           | 20/05/2024       | KRW     | 39.854.400             | Standard Chartered Bank, London     | 384  |
| USD   | 15.000           | 20/05/2024       | KRW     | 19.808.250             | J.P. Morgan Chase Bank, New York    | 280  |
| USD   | 10.000           | 20/05/2024       | KRW     | 13.110.700             | Crédit Agricole                     | 257  |
| ILS   | 529.567          | 21/05/2024       | USD     | 144.288                | Citibank, New York                  | 553  |
| USD   | 10.000           | 21/05/2024       | ILS     | 35.567                 | Merrill Lynch International Bank    | 272  |
| PEN   | 113.073          | 22/05/2024       | USD     | 30.000                 | J.P. Morgan Chase Bank, New York    | 361  |
| USD   | 40.000           | 23/05/2024       | CZK     | 936.532                | UBS, London                         | 4  |
| USD   | 10.000           | 23/05/2024       | CZK     | 231.291                | BNP Paribas                         | 122  |
| USD   | 10.000           | 23/05/2024       | CZK     | 232.856                | Barclays Bank, London               | 55   |
| USD   | 11.000           | 24/05/2024       | TWD     | 342.603                | Merrill Lynch International Bank    | 265  |
| USD   | 15.000           | 24/05/2024       | TWD     | 471.077                | UBS, London                         | 239  |
| EGP   | 2.517.500        | 28/05/2024       | USD     | 50.000                 | J.P. Morgan Chase Bank, New York    | 2.407  |
| USD   | 55.759           | 28/05/2024       | EGP     | 2.517.500              | J.P. Morgan Chase Bank, New York    | 3.352  |
| COP   | 39.720.793       | 07/06/2024       | USD     | 10.000                 | BNP Paribas                         | 166  |
| COP   | 178.361.100      | 07/06/2024       | USD     | 45.000                 | Merrill Lynch International Bank    | 647  |
| MXN   | 7.682.554        | 11/06/2024       | USD     | 430.000                | Citibank, New York                  | 27.168   |
| MXN   | 2.537.125        | 11/06/2024       | USD     | 145.484                | Morgan Stanley, London              | 5.494  |
| MXN   | 77.000           | 11/06/2024       | USD     | 4.483                  | Barclays Bank, London               | 99   |
| MXN   | 426.657          | 11/06/2024       | USD     | 25.000                 | BNP Paribas                         | 389  |
| MXN   | 6.802.480        | 11/06/2024       | USD     | 398.544                | Morgan Stanley, London              | 6.253  |
| USD   | 30.000           | 12/06/2024       | IDR     | 470.970.000            | Goldman Sachs International, London | 393  |
| USD   | 20.000           | 12/06/2024       | IDR     | 314.894.000            | BNP Paribas                         | 204  |
| USD   | 50.000           | 12/06/2024       | IDR     | 787.050.000            | J.P. Morgan Chase Bank, New York    | 523  |
| USD   | 10.000           | 12/06/2024       | IDR     | 156.520.000            | BNP Paribas                         | 160  |
| USD   | 10.000           | 12/06/2024       | IDR     | 155.483.000            | Morgan Stanley, London              | 226  |
| USD   | 10.000           | 12/06/2024       | IDR     | 157.774.000            | Morgan Stanley, London              | 82   |
| USD   | 70.000           | 14/06/2024       | CNY     | 497.189                | Barclays Bank, London               | 495  |
| USD   | 10.000           | 14/06/2024       | CNY     | 70.895                 | Goldman Sachs International, London | 89   |
| USD   | 10.000           | 14/06/2024       | CNY     | 70.971                 | Citibank, New York                  | 79   |
| USD   | 10.000           | 14/06/2024       | CNY     | 70.852                 | Goldman Sachs International, London | 95   |
| USD   | 10.000           | 14/06/2024       | CNY     | 70.850                 | Citibank, New York                  | 95   |
| USD   | 10.000           | 14/06/2024       | CNY     | 70.995                 | Citibank, New York                  | 75   |
| USD   | 380.000          | 14/06/2024       | CNY     | 2.715.860              | BNP Paribas                         | 335  |
| USD   | 10.000           | 14/06/2024       | CNY     | 71.241                 | Barclays Bank, London               | 41   |
| USD   | 10.000           | 18/06/2024       | EUR     | 9.190                  | Standard Chartered Bank, London     | 44   |
| USD   | 10.000           | 25/06/2024       | MYR     | 46.591                 | Morgan Stanley, London              | 202  |
| USD   | 10.000           | 25/06/2024       | MYR     | 47.209                 | Goldman Sachs International, London | 72   |
| USD   | 521.218          | 02/07/2024       | BRL     | 2.600.000              | Barclays Bank, London               | 6.234  |
| USD   | 15.000           | 05/07/2024       | TRY     | 534.186                | UBS, London                         | 214  |
| TRY   | 9.194.031        | 05/07/2024       | USD     | 250.000                | Standard Chartered Bank, London     | 4.484  |
| TRY   | 18.894           | 05/07/2024       | USD     | 512                    | BNP Paribas                         | 11   |

# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

| Teilfonds   | Im Austausch für | Erfüllungstermin | Währung | Kontrakt zur Lieferung | Kontrahent                          | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|---|------------------|------------------|---------|------------------------|-------------------------------------|--|
| <b>Global Emerging Markets Multi-Asset Income (Fortsetzung)</b> |                  |                  |         |                        |                                     |  |
| ZAR   | 191.056          | 09/07/2024       | USD     | 10.000                 | Merrill Lynch International Bank    | 8  |
| PHP   | 9.689.713        | 23/07/2024       | USD     | 172.011                | Standard Chartered Bank, London     | 192  |
| USD   | 10.000           | 02/08/2024       | BRL     | 50.478                 | Goldman Sachs International, London | 31   |
| USD   | 550.105          | 02/10/2024       | BRL     | 2.800.000              | Goldman Sachs International, London | 352  |
| USD   | 25.540           | 02/10/2024       | BRL     | 130.000                | Morgan Stanley, London              | 16   |
| EGP   | 2.759.000        | 24/03/2025       | USD     | 50.000                 | Standard Chartered Bank, London     | 1.623  |
|   |                  |                  |         |                        | <b>USD</b>                          | <b>109.232</b>   |
| USD   | 47.364           | 02/04/2024       | BRL     | 240.000                | Morgan Stanley, London              | (582)  |
| EGP   | 4.448.400        | 02/04/2024       | USD     | 120.000                | BNP Paribas                         | (26.172)   |
| BRL   | 2.800.000        | 02/04/2024       | USD     | 560.321                | Goldman Sachs International, London | (941)  |
| BRL   | 2.770.000        | 02/04/2024       | USD     | 556.152                | J.P. Morgan Chase Bank, New York    | (2.767)  |
| BRL   | 89.992           | 02/04/2024       | USD     | 18.083                 | Citibank, New York                  | (105)  |
| MYR   | 1.891.115        | 05/04/2024       | USD     | 406.508                | Barclays Bank, London               | (7.329)  |
| MYR   | 90.946           | 05/04/2024       | USD     | 20.000                 | Morgan Stanley, London              | (803)  |
| MYR   | 45.745           | 05/04/2024       | USD     | 10.000                 | Goldman Sachs International, London | (344)  |
| MYR   | 137.475          | 05/04/2024       | USD     | 30.000                 | Goldman Sachs International, London | (982)  |
| USD   | 35.000           | 05/04/2024       | MYR     | 167.157                | Crédit Agricole                     | (284)  |
| MYR   | 398.991          | 05/04/2024       | USD     | 85.000                 | Morgan Stanley, London              | (781)  |
| EGP   | 6.600.250        | 17/04/2024       | USD     | 170.000                | Standard Chartered Bank, London     | (31.230)   |
| USD   | 90.000           | 17/04/2024       | EGP     | 4.608.000              | Standard Chartered Bank, London     | (6.883)  |
| THB   | 36.392.244       | 24/04/2024       | USD     | 1.065.191              | Standard Chartered Bank, London     | (66.024)   |
| THB   | 639.146          | 24/04/2024       | USD     | 18.000                 | Standard Chartered Bank, London     | (452)  |
| THB   | 351.634          | 24/04/2024       | USD     | 10.000                 | Standard Chartered Bank, London     | (346)  |
| THB   | 718.054          | 24/04/2024       | USD     | 20.000                 | Standard Chartered Bank, London     | (285)  |
| THB   | 713.162          | 24/04/2024       | USD     | 20.000                 | Standard Chartered Bank, London     | (420)  |
| PLN   | 2.272.584        | 25/04/2024       | USD     | 571.407                | Barclays Bank, London               | (1.631)  |
| USD   | 42.000           | 25/04/2024       | PLN     | 169.881                | Barclays Bank, London               | (592)  |
| PLN   | 265.000          | 25/04/2024       | USD     | 66.455                 | Barclays Bank, London               | (15)   |
| USD   | 50.000           | 25/04/2024       | PLN     | 199.436                | Morgan Stanley, London              | (2)  |
| PLN   | 78.553           | 25/04/2024       | USD     | 20.000                 | Goldman Sachs International, London | (305)  |
| HUF   | 102.963.693      | 26/04/2024       | USD     | 294.820                | BNP Paribas                         | (13.064)   |
| HUF   | 10.250.000       | 26/04/2024       | USD     | 29.387                 | BNP Paribas                         | (1.339)  |
| HUF   | 7.295.450        | 26/04/2024       | USD     | 20.000                 | UBS, London                         | (36)   |
| GBP   | 2.354.343        | 30.04.2024       | USD     | 3.007.862              | HSBC Bank PLC                       | (33.291)   |
| USD   | 23.484           | 30.04.2024       | GBP     | 18.645                 | HSBC Bank PLC                       | (73)   |
| SGD   | 2.650            | 30.04.2024       | USD     | 1.983                  | HSBC Bank PLC                       | (16)   |
| SGD   | 15               | 30.04.2024       | USD     | 11                     | HSBC Bank PLC                       | -  |
| USD   | 13               | 30.04.2024       | SGD     | 18                     | HSBC Bank PLC                       | -  |

# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

| Teilfonds   | Im Austausch für | Erfüllungstermin | Währung | Kontrakt zur Lieferung | Kontrahent                          | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|---|------------------|------------------|---------|------------------------|-------------------------------------|--|
| <b>Global Emerging Markets Multi-Asset Income (Fortsetzung)</b> |                  |                  |         |                        |                                     |  |
| CNH   | 3.501.362        | 30.04.2024       | USD     | 486.872                | HSBC Bank PLC                       | (4.165)  |
| USD   | 3.500            | 30.04.2024       | CNH     | 25.404                 | HSBC Bank PLC                       | (2)  |
| AUD   | 3.572.631        | 30.04.2024       | USD     | 2.363.642              | HSBC Bank PLC                       | (31.057)   |
| AUD   | 27.160           | 30.04.2024       | USD     | 17.773                 | HSBC Bank PLC                       | (40)   |
| USD   | 17.117           | 30.04.2024       | AUD     | 26.362                 | HSBC Bank PLC                       | (95)   |
| EUR   | 1.423.210        | 30.04.2024       | USD     | 1.555.531              | HSBC Bank PLC                       | (16.677)   |
| EUR   | 8.176            | 30.04.2024       | USD     | 8.856                  | HSBC Bank PLC                       | (15)   |
| EUR   | 14.599           | 30.04.2024       | USD     | 15.844                 | HSBC Bank PLC                       | (60)   |
| USD   | 10.873           | 30.04.2024       | EUR     | 10.080                 | HSBC Bank PLC                       | (26)   |
| BRL   | 2.904.554        | 03/05/2024       | USD     | 583.233                | Goldman Sachs International, London | (4.748)  |
| USD   | 100.000          | 03/05/2024       | BRL     | 503.950                | Barclays Bank, London               | (369)  |
| BRL   | 300.902          | 03/05/2024       | USD     | 60.420                 | Citibank, New York                  | (491)  |
| BRL   | 474.080          | 03/05/2024       | USD     | 95.000                 | BNP Paribas                         | (580)  |
| BRL   | 100.085          | 03/05/2024       | USD     | 20.000                 | J.P. Morgan Chase Bank, New York    | (67)   |
| BRL   | 50.004           | 03/05/2024       | USD     | 10.000                 | Deutsche Bank, London               | (41)   |
| USD   | 10.000           | 03/05/2024       | BRL     | 50.426                 | J.P. Morgan Chase Bank, New York    | (43)   |
| PHP   | 11.089.203       | 09/05/2024       | USD     | 198.801                | UBS, London                         | (1.609)  |
| USD   | 172.121          | 09/05/2024       | PHP     | 9.689.713              | Standard Chartered Bank, London     | (185)  |
| CLP   | 84.028.965       | 10/05/2024       | USD     | 92.144                 | BNP Paribas                         | (6.573)  |
| CLP   | 13.874.550       | 10/05/2024       | USD     | 15.000                 | Morgan Stanley, London              | (871)  |
| USD   | 10.000           | 10/05/2024       | CLP     | 9.827.000              | Morgan Stanley, London              | (7)  |
| CLP   | 113.640.000      | 10/05/2024       | USD     | 120.000                | Citibank, New York                  | (4.275)  |
| CLP   | 9.449.200        | 10/05/2024       | USD     | 10.000                 | Merrill Lynch International Bank    | (377)  |
| RSD   | 2.856.611        | 13/05/2024       | USD     | 26.501                 | Standard Chartered Bank, London     | (155)  |
| INR   | 829.376          | 14/05/2024       | USD     | 10.000                 | Crédit Agricole                     | (65)   |
| RON   | 431.929          | 16/05/2024       | USD     | 94.036                 | BNP Paribas                         | (234)  |
| RON   | 45.870           | 16/05/2024       | USD     | 10.000                 | BNP Paribas                         | (38)   |
| USD   | 15.000           | 16/05/2024       | RON     | 69.595                 | Barclays Bank, London               | (114)  |
| RON   | 6.000            | 16/05/2024       | USD     | 1.307                  | Merrill Lynch International Bank    | (4)  |
| RON   | 45.538           | 16/05/2024       | USD     | 10.000                 | UBS, London                         | (111)  |
| KRW   | 1.377.078.295    | 20/05/2024       | USD     | 1.034.798              | BNP Paribas                         | (11.468)   |
| KRW   | 13.075.100       | 20/05/2024       | USD     | 10.000                 | Standard Chartered Bank, London     | (284)  |
| USD   | 103.902          | 22/05/2024       | PEN     | 399.858                | Crédit Agricole                     | (3.463)  |
| USD   | 10.000           | 22/05/2024       | PEN     | 37.685                 | Morgan Stanley, London              | (119)  |
| USD   | 10.000           | 22/05/2024       | PEN     | 37.286                 | BNP Paribas                         | (12)   |
| CZK   | 6.365.523        | 23/05/2024       | USD     | 274.305                | Morgan Stanley, London              | (2.454)  |
| USD   | 37.000           | 23/05/2024       | CZK     | 877.760                | Morgan Stanley, London              | (486)  |
| CZK   | 234.147          | 23/05/2024       | USD     | 10.000                 | Morgan Stanley, London              | -  |
| CZK   | 970.000          | 23/05/2024       | USD     | 41.709                 | Morgan Stanley, London              | (283)  |
| CZK   | 347.501          | 23/05/2024       | USD     | 15.000                 | UBS, London                         | (159)  |
| CZK   | 233.460          | 23/05/2024       | USD     | 10.000                 | Merrill Lynch International Bank    | (30)   |
| TWD   | 10.737.968       | 24/05/2024       | USD     | 345.461                | Crédit Agricole                     | (8.987)  |
| TWD   | 5.697.540        | 24/05/2024       | USD     | 180.000                | BNP Paribas                         | (1.468)  |
| TWD   | 6.352.000        | 24/05/2024       | USD     | 200.000                | J.P. Morgan Chase Bank, New York    | (960)  |
| USD   | 27.884           | 07/06/2024       | COP     | 113.528.701            | Morgan Stanley, London              | (1.170)  |
| USD   | 14.000           | 07/06/2024       | COP     | 55.987.680             | Merrill Lynch International Bank    | (329)  |
| USD   | 20.000           | 07/06/2024       | COP     | 80.022.400             | Merrill Lynch International Bank    | (480)  |
| USD   | 10.000           | 07/06/2024       | COP     | 39.616.200             | Morgan Stanley, London              | (139)  |

# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

| Teilfonds   | Im Austausch für | Erfüllungstermin | Währung | Kontrakt zur Lieferung | Kontrahent                          | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|---|------------------|------------------|---------|------------------------|-------------------------------------|--|
| <b>Global Emerging Markets Multi-Asset Income (Fortsetzung)</b> |                  |                  |         |                        |                                     |  |
| USD   | 43.000           | 11/06/2024       | MXN     | 747.212                | Goldman Sachs International, London | (1.465)  |
| USD   | 20.000           | 11/06/2024       | MXN     | 346.592                | Citibank, New York                  | (625)  |
| USD   | 50.000           | 11/06/2024       | MXN     | 863.458                | Standard Chartered Bank, London     | (1.382)  |
| USD   | 10.000           | 11/06/2024       | MXN     | 171.282                | BNP Paribas                         | (193)  |
| USD   | 67.709           | 11/06/2024       | MXN     | 1.155.000              | UBS, London                         | (1.022)  |
| USD   | 10.000           | 11/06/2024       | MXN     | 169.618                | UBS, London                         | (94)   |
| USD   | 240.000          | 11/06/2024       | MXN     | 4.112.134              | Citibank, New York                  | (4.702)  |
| USD   | 10.000           | 11/06/2024       | MXN     | 170.533                | BNP Paribas                         | (148)  |
| IDR   | 10.766.636.488   | 12/06/2024       | USD     | 689.908                | BNP Paribas                         | (13.072)   |
| IDR   | 942.150.000      | 12/06/2024       | USD     | 60.000                 | Standard Chartered Bank, London     | (772)  |
| IDR   | 471.141.000      | 12/06/2024       | USD     | 30.000                 | Morgan Stanley, London              | (382)  |
| IDR   | 389.262.500      | 12/06/2024       | USD     | 25.000                 | Morgan Stanley, London              | (529)  |
| CNY   | 14.515.261       | 14/06/2024       | USD     | 2.044.893              | BNP Paribas                         | (15.723)   |
| CNY   | 212.384          | 14/06/2024       | USD     | 30.000                 | BNP Paribas                         | (310)  |
| CNY   | 70.879           | 14/06/2024       | USD     | 10.000                 | Citibank, New York                  | (91)   |
| EUR   | 180.870          | 18/06/2024       | USD     | 196.373                | Merrill Lynch International Bank    | (419)  |
| EUR   | 9.122            | 18/06/2024       | USD     | 10.000                 | Merrill Lynch International Bank    | (117)  |
| SGD   | 730.834          | 24/06/2024       | USD     | 546.654                | Standard Chartered Bank, London     | (3.102)  |
| MYR   | 1.581.743        | 25/06/2024       | USD     | 340.043                | Morgan Stanley, London              | (7.406)  |
| MYR   | 69.872           | 25/06/2024       | USD     | 15.000                 | Crédit Agricole                     | (306)  |
| MYR   | 46.626           | 25/06/2024       | USD     | 10.000                 | Crédit Agricole                     | (195)  |
| TRY   | 7.845.200        | 05/07/2024       | USD     | 220.000                | UBS, London                         | (2.851)  |
| ZAR   | 5.347.426        | 09/07/2024       | USD     | 283.227                | Morgan Stanley, London              | (3.118)  |
| ZAR   | 377.071          | 09/07/2024       | USD     | 20.000                 | Merrill Lynch International Bank    | (248)  |
| USD   | 10.000           | 09/07/2024       | ZAR     | 191.026                | Morgan Stanley, London              | (6)  |
| USD   | 10.000           | 09/07/2024       | ZAR     | 191.533                | Morgan Stanley, London              | (33)   |
| PLN   | 2.247.699        | 15/07/2024       | USD     | 564.443                | Barclays Bank, London               | (1.492)  |
| THB   | 32.929.814       | 17/07/2024       | USD     | 916.805                | Standard Chartered Bank, London     | (6.262)  |
| THB   | 361.552          | 17/07/2024       | USD     | 10.000                 | Standard Chartered Bank, London     | (3)  |
| HUF   | 105.995.447      | 18/07/2024       | USD     | 289.182                | Merrill Lynch International Bank    | (295)  |
| USD   | 10.000           | 18/07/2024       | HUF     | 3.677.887              | Deutsche Bank, London               | (24)   |
| USD   | 212.028          | 24/07/2024       | CLP     | 209.296.883            | Goldman Sachs International, London | (832)  |
| BRL   | 1.889.606        | 02/08/2024       | USD     | 374.579                | Barclays Bank, London               | (1.412)  |
| <b>USD</b>  |                  |                  |         |                        |                                     | <b>(371.110)</b>   |

# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

| Teilfonds  | Im Austausch für | Erfüllungstermin | Währung | Kontrakt zur Lieferung | Kontrahent                               | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|--|------------------|------------------|---------|------------------------|--|--|
| <b>Managed Solutions – Asia Focused Conservative</b> |                  |                  |         |                        |  |  |
| AUD  | 6.746            | 30.04.2024       | USD     | 4.399                  | HSBC Bank PLC                            | 6  |
| USD  | 257.000          | 28/05/2024       | THB     | 9.214.298              | UBS                                      | 3.318  |
| USD  | 410.000          | 13/06/2024       | CNY     | 2.928.228              | State Street Bank and Trust Co, Hongkong | 643  |
|  |                  |                  |         |                        | USD                                      | 3.967  |
| EUR  | 2.321.037        | 30.04.2024       | USD     | 2.536.833              | HSBC Bank PLC                            | (27.196)   |
| EUR  | 11.897           | 30.04.2024       | USD     | 12.886                 | HSBC Bank PLC                            | (23)   |
| SGD  | 26.824           | 30.04.2024       | USD     | 20.068                 | HSBC Bank PLC                            | (167)  |
| SGD  | 135              | 30.04.2024       | USD     | 100                    | HSBC Bank PLC                            | -  |
| CNH  | 2.559.208        | 30.04.2024       | USD     | 355.863                | HSBC Bank PLC                            | (3.045)  |
| AUD  | 1.316.889        | 30.04.2024       | USD     | 871.250                | HSBC Bank PLC                            | (11.448)   |
| JPY  | 49.500.000       | 16/05/2024       | USD     | 336.328                | HSBC Bank PLC                            | (7.013)  |
| JPY  | 46.454.200       | 16/05/2024       | USD     | 315.833                | HSBC Bank PLC                            | (6.781)  |
| IDR  | 4.020.364.080    | 28/05/2024       | USD     | 257.000                | State Street Bank and Trust Co, Hongkong | (4.160)  |
| INR  | 34.030.943       | 13/06/2024       | USD     | 410.000                | State Street Bank and Trust Co, Hongkong | (2.755)  |
|  |                  |                  |         |                        | <b>USD</b>                               | <b>(62.588)</b>  |
| <b>Managed Solutions – Asia Focused Growth</b>       |                  |                  |         |                        |  |  |
| USD  | 4.473            | 30.04.2024       | EUR     | 4.129                  | HSBC Bank PLC                            | 9  |
| USD  | 146              | 30.04.2024       | SGD     | 196                    | HSBC Bank PLC                            | -  |
| AUD  | 34.564           | 30.04.2024       | USD     | 22.538                 | HSBC Bank PLC                            | 29   |
| USD  | 9.200            | 30.04.2024       | AUD     | 14.079                 | HSBC Bank PLC                            | 8  |
| USD  | 244.700          | 28/05/2024       | THB     | 8.773.303              | UBS                                      | 3.158  |
| USD  | 495.000          | 13/06/2024       | CNY     | 3.535.300              | State Street Bank and Trust Co, Hongkong | 777  |
|  |                  |                  |         |                        | USD                                      | 3.981  |
| EUR  | 695.155          | 30.04.2024       | USD     | 759.787                | HSBC Bank PLC                            | (8.146)  |
| EUR  | 10.125           | 30.04.2024       | USD     | 10.967                 | HSBC Bank PLC                            | (19)   |
| SGD  | 32.617           | 30.04.2024       | USD     | 24.403                 | HSBC Bank PLC                            | (203)  |
| SGD  | 472              | 30.04.2024       | USD     | 351                    | HSBC Bank PLC                            | -  |
| AUD  | 2.387.369        | 30.04.2024       | USD     | 1.579.476              | HSBC Bank PLC                            | (20.753)   |
| JPY  | 30.000.000       | 16/05/2024       | USD     | 203.835                | HSBC Bank PLC                            | (4.250)  |
| JPY  | 24.517.400       | 16/05/2024       | USD     | 166.689                | HSBC Bank PLC                            | (3.579)  |
| IDR  | 3.827.949.768    | 28/05/2024       | USD     | 244.700                | State Street Bank and Trust Co, Hongkong | (3.961)  |
| INR  | 41.086.139       | 13/06/2024       | USD     | 495.000                | State Street Bank and Trust Co, Hongkong | (3.326)  |
|  |                  |                  |         |                        | <b>USD</b>                               | <b>(44.237)</b>  |
| <b>Managed Solutions – Asia Focused Income</b>       |                  |                  |         |                        |  |  |
| USD  | 299              | 30.04.2024       | EUR     | 275                    | HSBC Bank PLC                            | 2  |
| USD  | 41.294           | 30.04.2024       | EUR     | 37.998                 | HSBC Bank PLC                            | 208  |
| USD  | 3.820            | 30.04.2024       | EUR     | 3.523                  | HSBC Bank PLC                            | 11   |
| GBP  | 1.340            | 30.04.2024       | USD     | 1.687                  | HSBC Bank PLC                            | 6  |
| USD  | 1.167            | 30.04.2024       | GBP     | 922                    | HSBC Bank PLC                            | 2  |
| USD  | 601              | 30.04.2024       | SGD     | 807                    | HSBC Bank PLC                            | 2  |
| USD  | 31.482           | 30.04.2024       | SGD     | 42.257                 | HSBC Bank PLC                            | 130  |
| USD  | 163              | 30.04.2024       | SGD     | 219                    | HSBC Bank PLC                            | -  |
| USD  | 3.086            | 30.04.2024       | SGD     | 4.143                  | HSBC Bank PLC                            | 13   |
| CNH  | 585.540          | 30.04.2024       | USD     | 80.696                 | HSBC Bank PLC                            | 28   |
| USD  | 67.121           | 30.04.2024       | CNH     | 485.647                | HSBC Bank PLC                            | 169  |
| USD  | 478.719          | 30.04.2024       | AUD     | 728.043                | HSBC Bank PLC                            | 3.377  |

# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

| Teilfonds  | Im Austausch für | Erfüllungstermin | Währung | Kontrakt zur Lieferung | Kontrahent                               | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|--|------------------|------------------|---------|------------------------|--|--|
| <b>Managed Solutions – Asia Focused Income (Fortsetzung)</b> |                  |                  |         |                        |  |  |
| AUD  | 395.842          | 30.04.2024       | USD     | 258.119                | HSBC Bank PLC                            | 328  |
| USD  | 188.765          | 30.04.2024       | AUD     | 287.860                | HSBC Bank PLC                            | 820  |
| CAD  | 32.776           | 30.04.2024       | USD     | 24.227                 | HSBC Bank PLC                            | 3  |
| CAD  | 34.083           | 30.04.2024       | USD     | 25.123                 | HSBC Bank PLC                            | 73   |
| USD  | 2.770.000        | 28/05/2024       | THB     | 99.313.641             | UBS                                      | 35.759   |
| USD  | 630.433          | 31/05/2024       | EUR     | 575.000                | Crédit Agricole                          | 7.980  |
| USD  | 195.000          | 31/05/2024       | KRW     | 257.634.507            | UBS                                      | 3.438  |
| PHP  | 18.791.842       | 31/05/2024       | USD     | 334.000                | Westpac Banking Sydney                   | 61   |
| USD  | 42.000           | 31/05/2024       | IDR     | 664.603.380            | State Street Bank and Trust Co, Hongkong | 207  |
| THB  | 1.300.000        | 31/05/2024       | USD     | 35.790                 | Crédit Agricole                          | 9  |
| USD  | 5.660.000        | 13/06/2024       | CNY     | 40.422.648             | State Street Bank and Trust Co, Hongkong | 9.051  |
|  |                  |                  |         |                        | <b>USD</b>                               | <b>61.677</b>  |
| AUD  | 43.074           | 30.04.2024       | USD     | 47.079                 | HSBC Bank PLC                            | (505)  |
| AUD  | 386              | 30.04.2024       | USD     | 418                    | HSBC Bank PLC                            | (1)  |
| AUD  | 5.977.557        | 30.04.2024       | USD     | 6.533.314              | HSBC Bank PLC                            | (70.044)   |
| AUD  | 52.984           | 30.04.2024       | USD     | 57.390                 | HSBC Bank PLC                            | (100)  |
| AUD  | 32.300           | 30.04.2024       | EUR     | 29.945                 | HSBC Bank PLC                            | (78)   |
| AUD  | 146.752          | 30.04.2024       | USD     | 187.487                | HSBC Bank PLC                            | (2.075)  |
| AUD  | 1.102            | 30.04.2024       | GBP     | 875                    | HSBC Bank PLC                            | (3)  |
| AUD  | 6.562.718        | 30.04.2024       | USD     | 4.909.862              | HSBC Bank PLC                            | (40.801)   |
| AUD  | 58.228           | 30.04.2024       | USD     | 43.248                 | HSBC Bank PLC                            | (47)   |
| AUD  | 11.522           | 30.04.2024       | USD     | 8.551                  | HSBC Bank PLC                            | (3)  |
| AUD  | 803              | 30.04.2024       | USD     | 596                    | HSBC Bank PLC                            | (1)  |
| AUD  | 641.479          | 30.04.2024       | USD     | 479.919                | HSBC Bank PLC                            | (3.988)  |
| AUD  | 2.400            | 30.04.2024       | USD     | 1.789                  | HSBC Bank PLC                            | (8)  |
| AUD  | 5.692            | 30.04.2024       | USD     | 4.227                  | HSBC Bank PLC                            | (5)  |
| AUD  | 66.556.238       | 30.04.2024       | USD     | 9.254.785              | HSBC Bank PLC                            | (79.177)   |
| AUD  | 3.812            | 30.04.2024       | CNH     | 27.664                 | HSBC Bank PLC                            | (2)  |
| AUD  | 44.149.249       | 30.04.2024       | USD     | 29.209.010             | HSBC Bank PLC                            | (383.785)  |
| AUD  | 15.607           | 30.04.2024       | AUD     | 23.914                 | HSBC Bank PLC                            | (6)  |
| AUD  | 148.840          | 30.04.2024       | AUD     | 229.237                | HSBC Bank PLC                            | (829)  |
| AUD  | 3.760.221        | 30.04.2024       | USD     | 2.789.692              | HSBC Bank PLC                            | (9.892)  |
| AUD  | 17.813           | 30.04.2024       | CAD     | 24.163                 | HSBC Bank PLC                            | (50)   |
| AUD  | 15.925           | 30.04.2024       | CAD     | 21.671                 | HSBC Bank PLC                            | (95)   |
| AUD  | 410.000.000      | 16/05/2024       | USD     | 2.785.751              | HSBC Bank PLC                            | (58.086)   |
| AUD  | 417.504.000      | 16/05/2024       | USD     | 2.838.530              | HSBC Bank PLC                            | (60.943)   |
| AUD  | 43.332.328.800   | 28/05/2024       | USD     | 2.770.000              | State Street Bank and Trust Co, Hongkong | (44.847)   |
| AUD  | 83.100.000       | 31/05/2024       | USD     | 558.916                | Crédit Agricole                          | (4.800)  |
| AUD  | 352.000          | 31/05/2024       | USD     | 264.047                | Citigroup Global Markets Limited         | (2.529)  |
| AUD  | 1.003.708.160    | 31/05/2024       | USD     | 64.000                 | State Street Bank and Trust Co, Hongkong | (882)  |
| AUD  | 152.124.450      | 31/05/2024       | USD     | 114.000                | State Street Bank and Trust Co, Hongkong | (889)  |
| AUD  | 69.000           | 31/05/2024       | USD     | 74.940                 | Merrill Lynch International Bank         | (247)  |

# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

| Teilfonds  | Im Austausch für | Erfüllungstermin | Währung | Kontrakt zur Lieferung | Kontrahent                               | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|--|------------------|------------------|---------|------------------------|--|--|
| <b>Managed Solutions – Asia Focused Income (Fortsetzung)</b> |                  |                  |         |                        |  |  |
| AUD  | 4.100.000        | 31/05/2024       | USD     | 113.187                | UBS                                      | (281)  |
| AUD  | 469.793.018      | 13/06/2024       | USD     | 5.660.000              | State Street Bank and Trust Co, Hongkong | (38.027)   |
|  |                  |                  |         |                        | <b>USD</b>                               | <b>(803.026)</b>   |
| <b>Multi-Asset Style Factors</b>                             |                  |                  |         |                        |  |  |
| AUD  | 25.996.002       | 30.04.2024       | EUR     | 23.789.263             | HSBC Bank PLC                            | 254.098  |
| AUD  | 212.284          | 30.04.2024       | EUR     | 196.014                | HSBC Bank PLC                            | 324  |
| AUD  | 27.797           | 30.04.2024       | EUR     | 25.637                 | HSBC Bank PLC                            | 72   |
| AUD  | 19.455           | 30.04.2024       | EUR     | 17.962                 | HSBC Bank PLC                            | 32   |
| AUD  | 1.338            | 30.04.2024       | EUR     | 1.558                  | HSBC Bank PLC                            | 6  |
| AUD  | 1.197.247        | 30.04.2024       | EUR     | 1.393.444              | HSBC Bank PLC                            | 5.640  |
| AUD  | 49.583           | 30.04.2024       | EUR     | 57.780                 | HSBC Bank PLC                            | 162  |
| AUD  | 16.626           | 30.04.2024       | EUR     | 19.369                 | HSBC Bank PLC                            | 60   |
| AUD  | 53.970           | 30.04.2024       | EUR     | 62.936                 | HSBC Bank PLC                            | 133  |
| AUD  | 5.660.616.753    | 30.04.2024       | EUR     | 34.479.206             | HSBC Bank PLC                            | 265.246  |
| AUD  | 37.818.817       | 30.04.2024       | EUR     | 231.954                | HSBC Bank PLC                            | 175  |
| AUD  | 1.562.780        | 30.04.2024       | EUR     | 1.605.051              | HSBC Bank PLC                            | 4.562  |
| AUD  | 86.276.159       | 12/06/2024       | SGD     | 125.530.000            | Société Générale, Paris                  | 121.786  |
| AUD  | 30.966.426       | 12/06/2024       | NZD     | 55.034.000             | Barclays Bank, London                    | 569.826  |
| AUD  | 20.000.000       | 12/06/2024       | EUR     | 18.216.282             | Crédit Agricole                          | 249.578  |
| AUD  | 880.680.000      | 12/06/2024       | EUR     | 42.526.526             | Bank of America                          | 169.197  |
| AUD  | 8.079.381        | 12/06/2024       | SEK     | 90.270.000             | Royal Bank of Canada, London             | 261.958  |
| AUD  | 5.220.412        | 12/06/2024       | JPY     | 829.270.000            | HSBC Bank PLC                            | 105.762  |
| AUD  | 26.428.548       | 12/06/2024       | PLN     | 113.780.000            | HSBC Bank PLC                            | 103.700  |
| AUD  | 42.094.547       | 12/06/2024       | AUD     | 69.700.000             | HSBC Bank PLC                            | 26.344   |
| AUD  | 145.349.417      | 12/06/2024       | CHF     | 138.505.000            | Crédit Agricole                          | 2.262.724  |
| AUD  | 33.243.820.000   | 12/06/2024       | EUR     | 83.461.130             | Société Générale, Paris                  | 323.923  |
| AUD  | 41.000.000       | 12/06/2024       | EUR     | 1.979.501              | Morgan Stanley, London                   | 8.196  |
| AUD  | 10.310.000       | 12/06/2024       | EUR     | 6.975.289              | Morgan Stanley, London                   | 66.180   |
| AUD  | 19.000.000       | 12/06/2024       | EUR     | 1.017.277              | Crédit Agricole                          | 26.465   |
| AUD  | 15.202.301       | 12/06/2024       | ZAR     | 312.620.000            | Bank of America                          | 46.357   |
| AUD  | 4.115.981        | 12/06/2024       | NOK     | 47.180.000             | Bank of America                          | 93.770   |
| AUD  | 13.786.346       | 12/06/2024       | JPY     | 2.201.190.000          | UBS                                      | 210.168  |
| AUD  | 12.674.398       | 12/06/2024       | AUD     | 20.980.000             | BNP Paribas                              | 11.687   |
| AUD  | 5.449.797        | 12/06/2024       | SEK     | 60.940.000             | BNP Paribas                              | 172.366  |
| AUD  | 11.180.000       | 12/06/2024       | EUR     | 7.564.977              | Citibank, New York                       | 70.680   |
| AUD  | 1.858.215        | 12/06/2024       | PLN     | 8.000.000              | UBS                                      | 7.285  |
| AUD  | 2.500.000        | 12/06/2024       | EUR     | 2.914.670              | Crédit Agricole                          | 2.367  |
| AUD  | 2.614.149        | 12/06/2024       | NOK     | 30.000.000             | HSBC Bank PLC                            | 56.575   |
| AUD  | 3.201.865        | 12/06/2024       | SGD     | 4.660.000              | BNP Paribas                              | 3.591  |
| AUD  | 3.040.004        | 12/06/2024       | JPY     | 491.870.000            | HSBC Bank PLC                            | 6.320  |
| AUD  | 4.388.253        | 12/06/2024       | GBP     | 3.760.000              | Bank of America                          | 1.030  |
| AUD  | 21.270.000       | 12/06/2024       | EUR     | 19.526.203             | BNP Paribas                              | 112.239  |
| AUD  | 5.060.000        | 12/06/2024       | EUR     | 4.642.341              | Crédit Agricole                          | 29.522   |
| AUD  | 13.040.000       | 12/06/2024       | EUR     | 700.111                | Société Générale, Paris                  | 16.226   |
| AUD  | 1.500.000        | 12/06/2024       | EUR     | 903.662                | Crédit Agricole                          | 1.679  |



# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

| Teilfonds                                      | Im Austausch für | Erfüllungstermin | Währung | Kontrakt zur Lieferung | Kontrahent                   | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|--|------------------|------------------|---------|------------------------|------------------------------|--|
| <b>Multi-Asset Style Factors (Fortsetzung)</b> |                  |                  |         |                        |                              |  |
| AUD  | 1.000.000        | 12/06/2024       | EUR     | 1.162.492              | Crédit Agricole              | 4.322  |
| AUD  | 1.000.000        | 12/06/2024       | EUR     | 679.336                | HSBC Bank PLC                | 3.639  |
| AUD  | 5.140.000        | 12/06/2024       | EUR     | 5.267.607              | Société Générale, Paris      | 42.423   |
| AUD  | 19.650.000       | 12/06/2024       | EUR     | 18.053.387             | Royal Bank of Canada, London | 89.320   |
| AUD  | 20.990.000       | 12/06/2024       | EUR     | 19.280.343             | Royal Bank of Canada, London | 99.577   |
| AUD  | 802.860.000      | 12/06/2024       | EUR     | 2.014.552              | HSBC Bank PLC                | 8.911  |
| AUD  | 65.400.000       | 12/06/2024       | EUR     | 3.153.028              | BNP Paribas                  | 17.590   |
| AUD  | 1.116.070.000    | 12/06/2024       | EUR     | 6.850.180              | Morgan Stanley, London       | 33.353   |
| AUD  | 108.586.768      | 14/06/2024       | KRW     | 155.275.820.000        | Crédit Agricole              | 1.918.089  |
| AUD  | 1.664.990.000    | 14/06/2024       | EUR     | 18.265.282             | Crédit Agricole              | 128.814  |
| AUD  | 73.071.703       | 14/06/2024       | IDR     | 1.245.214.890.000      | Crédit Agricole              | 807.061  |
| AUD  | 342.860.720.000  | 14/06/2024       | EUR     | 78.887.107             | HSBC Bank PLC                | 2.031.705  |
| AUD  | 16.456.000       | 14/06/2024       | EUR     | 2.996.757              | Royal Bank of Canada, London | 17.927   |
| AUD  | 1.750.840.000    | 14/06/2024       | EUR     | 19.219.450             | UBS                          | 123.080  |
| AUD  | 5.286.691        | 14/06/2024       | CLP     | 5.616.210.000          | Morgan Stanley, London       | 10.635   |
| AUD  | 72.350.000       | 14/06/2024       | EUR     | 13.148.973             | HSBC Bank PLC                | 105.305  |
| AUD  | 67.360.000       | 14/06/2024       | EUR     | 12.179.491             | Morgan Stanley, London       | 160.636  |
| AUD  | 10.100.894       | 14/06/2024       | CLP     | 10.616.040.000         | Crédit Agricole              | 127.831  |
| AUD  | 111.751.170.000  | 14/06/2024       | EUR     | 6.485.096              | Société Générale, Paris      | 257  |
| AUD  | 4.120.730.000    | 14/06/2024       | EUR     | 3.853.743              | Société Générale, Paris      | 17.409   |
| <b>EUR</b>                                     |                  |                  |         |                        |                              | <b>11.415.895</b>  |
| AUD  | 145.796          | 30.04.2024       | USD     | 158.590                | HSBC Bank PLC                | (881)  |
| AUD  | 164.400          | 30.04.2024       | EUR     | 192.185                | HSBC Bank PLC                | (70)   |
| AUD  | 144.251.234      | 30.04.2024       | EUR     | 168.631.071            | HSBC Bank PLC                | (61.345)   |
| AUD  | 16.171           | 30.04.2024       | GBP     | 13.880                 | HSBC Bank PLC                | (49)   |
| AUD  | 45.250           | 30.04.2024       | GBP     | 38.879                 | HSBC Bank PLC                | (183)  |
| AUD  | 11.415           | 30.04.2024       | EUR     | 11.780                 | HSBC Bank PLC                | (23)   |
| AUD  | 1.300.000        | 12/06/2024       | EUR     | 1.521.339              | Crédit Agricole              | (4.480)  |
| AUD  | 2.800.000        | 12/06/2024       | EUR     | 2.937.703              | Crédit Agricole              | (45.080)   |
| AUD  | 102.000.000      | 12/06/2024       | EUR     | 9.122.241              | Bank of America              | (288.995)  |
| AUD  | 2.350.474        | 12/06/2024       | USD     | 2.580.000              | Royal Bank of Canada, London | (31.622)   |
| AUD  | 20.000.000       | 12/06/2024       | EUR     | 4.644.800              | HSBC Bank PLC                | (17.477)   |
| AUD  | 1.800.000        | 12/06/2024       | EUR     | 1.012.689              | HSBC Bank PLC                | (18.506)   |
| AUD  | 7.500.000        | 12/06/2024       | EUR     | 4.528.912              | Barclays Bank, London        | (2.205)  |
| AUD  | 65.745.000       | 12/06/2024       | EUR     | 76.944.215             | Crédit Agricole              | (231.982)  |
| AUD  | 1.352.911.000    | 12/06/2024       | EUR     | 118.217.378            | Crédit Agricole              | (2.878.379)  |
| AUD  | 68.000.000       | 12/06/2024       | EUR     | 5.942.457              | Morgan Stanley, London       | (145.289)  |
| AUD  | 20.925.851       | 12/06/2024       | MXN     | 390.920.000            | Morgan Stanley, London       | (548.877)  |
| AUD  | 3.699.949        | 12/06/2024       | USD     | 4.060.000              | HSBC Bank PLC                | (48.621)   |
| AUD  | 9.000.000        | 12/06/2024       | EUR     | 6.188.221              | UBS                          | (11.296)   |
| AUD  | 11.881.337       | 12/06/2024       | GBP     | 10.190.000             | Citibank, New York           | (8.505)  |
| AUD  | 23.340.000       | 12/06/2024       | EUR     | 13.107.441             | Morgan Stanley, London       | (216.198)  |
| AUD  | 2.476.987        | 12/06/2024       | MXN     | 46.300.000             | Société Générale, Paris      | (66.449)   |

# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

| Teilfonds                                      | Im Austausch für | Erfüllungstermin | Währung | Kontrakt zur Lieferung | Kontrahent                   | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|--|------------------|------------------|---------|------------------------|------------------------------|--|
| <b>Multi-Asset Style Factors (Fortsetzung)</b> |                  |                  |         |                        |                              |  |
| AUD  | 3.000.000        | 12/06/2024       | EUR     | 3.144.398              | Crédit Agricole              | (45.159)   |
| AUD  | 10.996.240       | 12/06/2024       | ZAR     | 228.760.000            | Morgan Stanley, London       | (94.138)   |
| AUD  | 35.190.000       | 12/06/2024       | EUR     | 19.566.078             | HSBC Bank PLC                | (129.796)  |
| AUD  | 54.290.000       | 12/06/2024       | EUR     | 4.678.933              | Société Générale, Paris      | (50.576)   |
| AUD  | 97.320.000       | 12/06/2024       | EUR     | 8.585.536              | Société Générale, Paris      | (157.580)  |
| AUD  | 16.726.833       | 12/06/2024       | AUD     | 27.870.000             | BNP Paribas                  | (94.413)   |
| AUD  | 25.605.046       | 12/06/2024       | CAD     | 37.900.000             | Morgan Stanley, London       | (279.695)  |
| AUD  | 20.000.000       | 12/06/2024       | EUR     | 1.720.586              | Crédit Agricole              | (15.536)   |
| AUD  | 20.000.000       | 12/06/2024       | EUR     | 1.755.853              | Crédit Agricole              | (23.844)   |
| AUD  | 1.848.386        | 12/06/2024       | PLN     | 8.000.000              | Morgan Stanley, London       | (2.544)  |
| AUD  | 3.683.798        | 12/06/2024       | USD     | 4.000.000              | Morgan Stanley, London       | (9.374)  |
| AUD  | 9.111.552        | 12/06/2024       | SGD     | 13.290.000             | Morgan Stanley, London       | (9.707)  |
| AUD  | 34.859.044       | 12/06/2024       | CAD     | 51.380.000             | Royal Bank of Canada, London | (232.196)  |
| AUD  | 8.133.046        | 12/06/2024       | AUD     | 13.490.000             | BNP Paribas                  | (8.992)  |
| AUD  | 170.320.000      | 12/06/2024       | EUR     | 14.638.179             | BNP Paribas                  | (117.979)  |
| AUD  | 10.385.442       | 12/06/2024       | GBP     | 8.940.000              | BNP Paribas                  | (45.882)   |
| AUD  | 5.490.560        | 12/06/2024       | MXN     | 100.860.000            | HSBC Bank PLC                | (50.065)   |
| AUD  | 53.280.000       | 12/06/2024       | EUR     | 29.462.020             | Morgan Stanley, London       | (34.196)   |
| AUD  | 29.928.650.000   | 14/06/2024       | EUR     | 28.227.119             | Barclays Bank, London        | (111.143)  |
| AUD  | 30.772.510.000   | 14/06/2024       | EUR     | 1.793.667              | Barclays Bank, London        | (7.819)  |
| AUD  | 14.192.300.000   | 14/06/2024       | EUR     | 9.784.959              | Barclays Bank, London        | (35.380)   |
| AUD  | 7.203.705        | 14/06/2024       | COP     | 31.144.930.000         | Morgan Stanley, London       | (146.833)  |
| AUD  | 22.848.610.000   | 14/06/2024       | EUR     | 15.726.101             | Barclays Bank, London        | (29.961)   |
| AUD  | 7.740.694        | 14/06/2024       | COP     | 33.091.080.000         | Bank of America              | (69.156)   |
| <b>EUR</b>                                     |                  |                  |         |                        |                              | <b>(6.428.476)</b>   |
| <b>Multi-Strategy Target Return</b>            |                  |                  |         |                        |                              |  |
| AUD  | 55               | 30.04.2024       | EUR     | 64                     | HSBC Bank PLC                | -  |
| AUD  | 35               | 30.04.2024       | EUR     | 41                     | HSBC Bank PLC                | -  |
| AUD  | 56               | 30.04.2024       | EUR     | 65                     | HSBC Bank PLC                | -  |
| AUD  | 35               | 30.04.2024       | EUR     | 41                     | HSBC Bank PLC                | -  |
| AUD  | 934.387          | 30.04.2024       | EUR     | 1.088.626              | HSBC Bank PLC                | 3.283  |
| AUD  | 76.549           | 30.04.2024       | EUR     | 89.186                 | HSBC Bank PLC                | 269  |
| AUD  | 582.344          | 30.04.2024       | EUR     | 677.774                | HSBC Bank PLC                | 2.743  |
| AUD  | 27.523           | 30.04.2024       | EUR     | 32.034                 | HSBC Bank PLC                | 130  |
| AUD  | 19.792           | 30.04.2024       | EUR     | 23.057                 | HSBC Bank PLC                | 72   |
| AUD  | 37.707           | 30.04.2024       | EUR     | 43.971                 | HSBC Bank PLC                | 93   |
| AUD  | 11.277.723       | 12/06/2024       | SGD     | 16.410.000             | HSBC Bank PLC                | 15.130   |
| AUD  | 14.630.000       | 12/06/2024       | EUR     | 1.865.010              | HSBC Bank PLC                | 32.056   |
| AUD  | 2.396.330.000    | 12/06/2024       | EUR     | 6.014.458              | Société Générale, Paris      | 25.059   |
| AUD  | 3.178.952        | 12/06/2024       | GBP     | 2.715.000              | Royal Bank of Canada, London | 11.050   |
| AUD  | 8.883.309        | 12/06/2024       | AUD     | 14.710.000             | HSBC Bank PLC                | 4.927  |
| AUD  | 2.189.534        | 12/06/2024       | PLN     | 9.430.000              | HSBC Bank PLC                | 7.751  |

# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

| Teilfonds   | Im Austausch für | Erfüllungstermin | Währung | Kontrakt zur Lieferung | Kontrahent                   | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|---|------------------|------------------|---------|------------------------|------------------------------|--|
| <b>Multi-Strategy Target Return (Fortsetzung)</b> |                  |                  |         |                        |                              |  |
| AUD   | 76.710.000       | 12/06/2024       | EUR     | 3.703.629              | Bank of America              | 15.303   |
| AUD   | 5.412.708        | 12/06/2024       | NZD     | 9.620.000              | Morgan Stanley, London       | 99.351   |
| AUD   | 13.649.711       | 12/06/2024       | CHF     | 13.010.000             | Morgan Stanley, London       | 209.347  |
| AUD   | 17.000.000       | 12/06/2024       | EUR     | 909.505                | Crédit Agricole              | 24.370   |
| AUD   | 1.150.000        | 12/06/2024       | EUR     | 1.048.470              | Société Générale, Paris      | 13.317   |
| AUD   | 2.571.267        | 12/06/2024       | JPY     | 410.560.000            | Citibank, New York           | 39.075   |
| AUD   | 702.865          | 12/06/2024       | CHF     | 670.000                | Société Générale, Paris      | 10.701   |
| AUD   | 1.680.000        | 12/06/2024       | EUR     | 1.137.106              | HSBC Bank PLC                | 10.291   |
| AUD   | 824.404          | 12/06/2024       | SEK     | 9.220.000              | Royal Bank of Canada, London | 25.949   |
| AUD   | 480.780          | 12/06/2024       | ZAR     | 9.910.000              | HSBC Bank PLC                | 339  |
| AUD   | 760.617          | 12/06/2024       | AUD     | 1.260.000              | HSBC Bank PLC                | 131  |
| AUD   | 501.301          | 12/06/2024       | SGD     | 730.000                | Société Générale, Paris      | 283  |
| AUD   | 6.400.000        | 12/06/2024       | EUR     | 343.325                | Citibank, New York           | 8.252  |
| AUD   | 5.100.000        | 12/06/2024       | EUR     | 4.683.333              | Crédit Agricole              | 25.461   |
| AUD   | 2.250.000        | 12/06/2024       | EUR     | 518.276                | HSBC Bank PLC                | 2.298  |
| AUD   | 98.800.000       | 12/06/2024       | EUR     | 247.949                | Bank of America              | 1.059  |
| AUD   | 1.049.350        | 12/06/2024       | NOK     | 12.180.000             | Morgan Stanley, London       | 10.975   |
| AUD   | 500.000          | 12/06/2024       | EUR     | 512.830                | Crédit Agricole              | 3.709  |
| AUD   | 630.513          | 12/06/2024       | SEK     | 7.220.000              | HSBC Bank PLC                | 5.258  |
| AUD   | 9.590.000        | 12/06/2024       | EUR     | 462.812                | HSBC Bank PLC                | 2.115  |
| AUD   | 12.040.000       | 12/06/2024       | EUR     | 11.060.855             | Morgan Stanley, London       | 55.592   |
| AUD   | 12.293.448       | 14/06/2024       | KRW     | 17.577.910.000         | HSBC Bank PLC                | 218.082  |
| AUD   | 8.254.935        | 14/06/2024       | IDR     | 140.606.310.000        | HSBC Bank PLC                | 95.006   |
| AUD   | 1.634.996        | 14/06/2024       | TWD     | 56.030.000             | Crédit Agricole              | 11.690   |
| AUD   | 14.554.600       | 14/06/2024       | EUR     | 2.645.865              | Royal Bank of Canada, London | 20.489   |
| AUD   | 35.474.960.000   | 14/06/2024       | EUR     | 8.167.187              | Royal Bank of Canada, London | 205.285  |
| AUD   | 370.320.000      | 14/06/2024       | EUR     | 4.061.047              | Barclays Bank, London        | 30.089   |
| AUD   | 794.111          | 14/06/2024       | CLP     | 839.900.000            | UBS                          | 5.081  |
| AUD   | 9.140.000        | 14/06/2024       | EUR     | 1.660.218              | Société Générale, Paris      | 14.199   |
| AUD   | 171.200.000      | 14/06/2024       | EUR     | 1.881.629              | HSBC Bank PLC                | 9.715  |
| AUD   | 475.461          | 14/06/2024       | CLP     | 498.200.000            | Royal Bank of Canada, London | 7.435  |
| AUD   | 314.177          | 14/06/2024       | KRW     | 457.150.000            | UBS                          | 132  |
|   |                  |                  |         |                        | <b>EUR</b>                   | <b>1.282.942</b>   |
| AUD   | 4.728            | 30.04.2024       | EUR     | 5.527                  | HSBC Bank PLC                | (2)  |
| AUD   | 4.755            | 30.04.2024       | EUR     | 5.559                  | HSBC Bank PLC                | (2)  |
| AUD   | 78.577.695       | 30.04.2024       | EUR     | 91.858.076             | HSBC Bank PLC                | (33.416)   |
| AUD   | 25.899           | 30.04.2024       | GBP     | 22.225                 | HSBC Bank PLC                | (73)   |
| AUD   | 481.485.000      | 12/06/2024       | EUR     | 3.030.893              | Crédit Agricole              | (61.261)   |
| AUD   | 10.833.673       | 12/06/2024       | USD     | 11.893.000             | Royal Bank of Canada, London | (147.051)  |

# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

| Teilfonds   | Im Austausch für | Erfüllungstermin | Währung | Kontrakt zur Lieferung | Kontrahent                   | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|---|------------------|------------------|---------|------------------------|------------------------------|--|
| <b>Multi-Strategy Target Return (Fortsetzung)</b> |                  |                  |         |                        |                              |  |
| AUD   | 4.670.000        | 12/06/2024       | EUR     | 417.632                | Bank of America              | (13.208)   |
| AUD   | 3.216.928        | 12/06/2024       | CAD     | 4.755.000              | BNP Paribas                  | (30.616)   |
| AUD   | 114.020.000      | 12/06/2024       | EUR     | 9.967.521              | Morgan Stanley, London       | (247.035)  |
| AUD   | 4.730.000        | 12/06/2024       | EUR     | 410.768                | Société Générale, Paris      | (7.524)  |
| AUD   | 3.120.000        | 12/06/2024       | EUR     | 2.145.246              | Royal Bank of Canada, London | (3.912)  |
| AUD   | 420.353          | 12/06/2024       | MXN     | 7.860.000              | Bank of America              | (11.427)   |
| AUD   | 8.551.351        | 12/06/2024       | USD     | 9.370.000              | HSBC Bank PLC                | (99.904)   |
| AUD   | 3.010.000        | 12/06/2024       | EUR     | 1.688.200              | BNP Paribas                  | (25.704)   |
| AUD   | 530.000          | 12/06/2024       | EUR     | 618.595                | BNP Paribas                  | (184)  |
| AUD   | 2.640.000        | 12/06/2024       | EUR     | 1.465.656              | Citibank, New York           | (7.521)  |
| AUD   | 322.650.000      | 12/06/2024       | EUR     | 1.991.863              | Crédit Agricole              | (1.870)  |
| AUD   | 933.149          | 12/06/2024       | GBP     | 800.000                | Barclays Bank, London        | (303)  |
| AUD   | 672.067          | 12/06/2024       | AUD     | 1.120.000              | HSBC Bank PLC                | (3.921)  |
| AUD   | 3.789.812        | 12/06/2024       | CAD     | 5.610.000              | HSBC Bank PLC                | (41.676)   |
| AUD   | 1.095.586        | 12/06/2024       | ZAR     | 22.730.000             | HSBC Bank PLC                | (6.373)  |
| AUD   | 1.638.088        | 12/06/2024       | GBP     | 1.410.000              | Citibank, New York           | (7.121)  |
| AUD   | 2.776.447        | 12/06/2024       | SGD     | 4.050.000              | Citibank, New York           | (3.169)  |
| AUD   | 594.022          | 12/06/2024       | PLN     | 2.570.000              | HSBC Bank PLC                | (589)  |
| AUD   | 3.620.000        | 12/06/2024       | EUR     | 2.001.589              | HSBC Bank PLC                | (2.176)  |
| AUD   | 521.851          | 12/06/2024       | JPY     | 85.020.000             | UBS                          | (2.523)  |
| AUD   | 1.265.800        | 12/06/2024       | AUD     | 2.100.000              | HSBC Bank PLC                | (1.678)  |
| AUD   | 3.059.529        | 12/06/2024       | CAD     | 4.510.000              | BNP Paribas                  | (20.687)   |
| AUD   | 16.700.000       | 12/06/2024       | EUR     | 1.433.951              | Morgan Stanley, London       | (10.235)   |
| AUD   | 1.769.180.000    | 14/06/2024       | EUR     | 1.664.515              | Barclays Bank, London        | (2.488)  |
| AUD   | 1.873.480.000    | 14/06/2024       | EUR     | 1.308.741              | UBS                          | (21.730)   |
| AUD   | 22.686.680.000   | 14/06/2024       | EUR     | 1.329.583              | HSBC Bank PLC                | (12.987)   |
| AUD   | 904.454          | 14/06/2024       | BRL     | 5.000.000              | Société Générale, Paris      | (11.530)   |
| AUD   | 1.414.970.000    | 14/06/2024       | EUR     | 974.609                | UBS                          | (2.578)  |
| AUD   | 396.833          | 14/06/2024       | COP     | 1.713.330.000          | Royal Bank of Canada, London | (7.531)  |
| AUD   | 6.291.050.000    | 14/06/2024       | EUR     | 366.103                | Royal Bank of Canada, London | (1.009)  |
| <b>EUR</b>  |                  |                  |         |                        |                              | <b>(851.014)</b>   |
| <b>US Income Focused</b>                          |                  |                  |         |                        |                              |  |
| AUD   | 108.195          | 30.04.2024       | USD     | 136.206                | HSBC Bank PLC                | 490  |
| AUD   | 89.100           | 30.04.2024       | USD     | 112.298                | HSBC Bank PLC                | 273  |
| AUD   | 29.971           | 30.04.2024       | USD     | 37.856                 | HSBC Bank PLC                | 10   |
| AUD   | 151.736          | 30.04.2024       | USD     | 1.006                  | HSBC Bank PLC                | -  |
| AUD   | 1.161.023        | 30.04.2024       | USD     | 160.007                | HSBC Bank PLC                | 54   |
| AUD   | 1.759.836        | 30.04.2024       | USD     | 242.488                | HSBC Bank PLC                | 126  |
| AUD   | 20.447           | 30.04.2024       | CNH     | 147.934                | HSBC Bank PLC                | 51   |

# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

| Teilfonds                              | Im Austausch für | Erfüllungstermin | Währung | Kontrakt zur Lieferung | Kontrahent    | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|--|------------------|------------------|---------|------------------------|---------------|--|
| <b>US Income Focused (Fortsetzung)</b> |                  |                  |         |                        |               |  |
| AUD                                    | 175.684          | 30.04.2024       | CNH     | 1.273.377              | HSBC Bank PLC | 132  |
| AUD                                    | 27.935           | 30.04.2024       | AUD     | 42.484                 | HSBC Bank PLC | 196  |
| AUD                                    | 363.311          | 30.04.2024       | USD     | 236.906                | HSBC Bank PLC | 300  |
| AUD                                    | 161.468          | 30.04.2024       | USD     | 105.381                | HSBC Bank PLC | 42   |
| AUD                                    | 2.180.937        | 30.04.2024       | AUD     | 3.340.338              | HSBC Bank PLC | 16   |
| AUD                                    | 119.131          | 30.04.2024       | USD     | 87.815                 | HSBC Bank PLC | 254  |
| AUD                                    | 9.475            | 30.04.2024       | USD     | 6.973                  | HSBC Bank PLC | 30   |
|  |                  |                  |         |                        | <b>USD</b>    | <b>1.974</b>   |
| AUD                                    | 3.530.277        | 30.04.2024       | USD     | 3.858.501              | HSBC Bank PLC | (41.366)   |
| AUD                                    | 25.322           | 30.04.2024       | USD     | 27.427                 | HSBC Bank PLC | (48)   |
| AUD                                    | 31.269           | 30.04.2024       | USD     | 33.937                 | HSBC Bank PLC | (128)  |
| AUD                                    | 220.475          | 30.04.2024       | USD     | 238.819                | HSBC Bank PLC | (429)  |
| AUD                                    | 25.904           | 30.04.2024       | EUR     | 24.016                 | HSBC Bank PLC | (63)   |
| AUD                                    | 14.727.053       | 30.04.2024       | USD     | 18.814.989             | HSBC Bank PLC | (208.247)  |
| AUD                                    | 170.316          | 30.04.2024       | USD     | 215.778                | HSBC Bank PLC | (594)  |
| AUD                                    | 27.641           | 30.04.2024       | USD     | 34.956                 | HSBC Bank PLC | (33)   |
| AUD                                    | 986.491          | 30.04.2024       | GBP     | 781.102                | HSBC Bank PLC | (385)  |
| AUD                                    | 139.533          | 30.04.2024       | GBP     | 110.784                | HSBC Bank PLC | (436)  |
| AUD                                    | 165.250.861      | 30.04.2024       | USD     | 22.978.479             | HSBC Bank PLC | (196.588)  |
| AUD                                    | 226.416          | 30.04.2024       | USD     | 31.429                 | HSBC Bank PLC | (215)  |
| AUD                                    | 1.960.000        | 30.04.2024       | USD     | 270.866                | HSBC Bank PLC | (656)  |
| AUD                                    | 160.878          | 30.04.2024       | CNH     | 1.167.764              | HSBC Bank PLC | (112)  |
| AUD                                    | 50.951.973       | 30.04.2024       | USD     | 33.709.673             | HSBC Bank PLC | (442.920)  |
| AUD                                    | 181.266          | 30.04.2024       | USD     | 118.614                | HSBC Bank PLC | (265)  |
| AUD                                    | 233.880          | 30.04.2024       | AUD     | 360.212                | HSBC Bank PLC | (1.303)  |
| AUD                                    | 16.424.230       | 30.04.2024       | USD     | 12.185.069             | HSBC Bank PLC | (43.208)   |
| AUD                                    | 90.122           | 30.04.2024       | CAD     | 122.637                | HSBC Bank PLC | (540)  |
|  |                  |                  |         |                        | <b>USD</b>    | <b>(937.536)</b>   |

# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## Futures

Im Verlauf des Geschäftsjahres zum 31. März 2024 hat die Gesellschaft finanzielle Futures-Kontrakte abgeschlossen. Bei Abschluss eines Kontrakts hinterlegt die Gesellschaft Bargeld als Sicherheit. Die erforderlichen Nachschussforderungen in bar zur Deckung der vertraglich festgelegten Margen werden in den Bargeldkonten der Gesellschaft täglich angepasst, und Ergebnisse aus offenen Positionen gelten zu dem Zeitpunkt als realisiert. Die Marge wird berechnet als der Unterschied zwischen dem Wert des Kontrakts am vorherigen Bewertungstag und dem Wert des Finanz-Futures am Bewertungstag. Auf Einschusskonten gehaltene Barmittel sind in der Aufstellung des Nettovermögens unter „Bankguthaben“ aufgeführt.

Am 31. März 2024 hat die Gesellschaft die folgenden offenen Futures-Positionen:

| Basiswert                               | Anzahl Kontrakte Kauf/(Verkauf) | Währung | Commitment in Währung des Teilfonds | Fälligkeits-termin | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|---|---------------------------------|---------|-------------------------------------|--------------------|--|
| <b>China A-Shares Equity</b>            |                                 |         |                                     |                    |  |
| FTSE CHINA A50 INDEX*                   | USD                             | 10      | 121.655                             | 29/04/2024         | (125)  |
|   |                                 |         |                                     | <b>USD</b>         | <b>(125)</b>   |
| <b>Euroland Growth</b>                  |                                 |         |                                     |                    |  |
| EURO STOXX 50*                          | EUR                             | 52      | 2.623.660                           | 21/06/2024         | 83.200   |
|   |                                 |         |                                     | <b>EUR</b>         | <b>83.200</b>  |
| <b>Euroland Value</b>                   |                                 |         |                                     |                    |  |
| EURO STOXX 50*                          | EUR                             | 66      | 3.330.030                           | 21/06/2024         | 99.000   |
|   |                                 |         |                                     | <b>EUR</b>         | <b>99.000</b>  |
| <b>Global Lower Carbon Equity</b>       |                                 |         |                                     |                    |  |
| MINI TOPIX INDEX*                       | JPY                             | 17      | 310.512                             | 13/06/2024         | 6.605  |
| CME S&P500 EMINI FUT*                   | USD                             | 15      | 3.985.969                           | 21/06/2024         | 87.891   |
| EURO STOXX 50*                          | EUR                             | 20      | 1.089.828                           | 21/06/2024         | 31.736   |
|   |                                 |         |                                     | <b>USD</b>         | <b>126.232</b>   |
| <b>Global Sustainable Equity Income</b> |                                 |         |                                     |                    |  |
| MSCI WORLD INDEX*                       | USD                             | 19      | 2.072.710                           | 21/06/2024         | 43.890   |
|   |                                 |         |                                     | <b>USD</b>         | <b>43.890</b>  |
| <b>Global Equity Volatility Focused</b> |                                 |         |                                     |                    |  |
| CME S&P500 EMINI FUT*                   | USD                             | 3       | 797.194                             | 21/06/2024         | 14.434   |
| MSCI EAFE*                              | USD                             | 3       | 353.760                             | 21/06/2024         | 3.030  |
|   |                                 |         |                                     | <b>USD</b>         | <b>17.464</b>  |
| MSCI EMERGING MKT INDEX*                | USD                             | 2       | 105.085                             | 21/06/2024         | (165)  |
|   |                                 |         |                                     | <b>USD</b>         | <b>(165)</b>   |
| <b>Economic Scale US Equity</b>         |                                 |         |                                     |                    |  |
| CME S&P500 EMINI FUT*                   | USD                             | 9       | 2.391.581                           | 21/06/2024         | 50.489   |
|   |                                 |         |                                     | <b>USD</b>         | <b>50.489</b>  |
| <b>Asia Bond</b>                        |                                 |         |                                     |                    |  |
| US 10yr ULTRA*                          | USD                             | 64      | 7.340.500                           | 18/06/2024         | 13.375   |
| US ULTRA BOND*                          | USD                             | 19      | 2.454.859                           | 18/06/2024         | 42.828   |
| 5Y TREASURY NOTES USA*                  | USD                             | 226     | 24.197.008                          | 28/06/2024         | 18.795   |
|   |                                 |         |                                     | <b>USD</b>         | <b>74.998</b>  |
| US LONG BOND*                           | USD                             | (34)    | (4.099.656)                         | 18/06/2024         | (47.781)   |
|   |                                 |         |                                     | <b>USD</b>         | <b>(47.781)</b>  |
| <b>Asia High Yield Bond</b>             |                                 |         |                                     |                    |  |
| US ULTRA BOND*                          | USD                             | 160     | 20.672.500                          | 18/06/2024         | 53.269   |
| 10Y TREASURY NOTES USA*                 | USD                             | 150     | 16.630.079                          | 18/06/2024         | 24.610   |
|   |                                 |         |                                     | <b>USD</b>         | <b>77.879</b>  |
| <b>Euro Bond Total Return</b>           |                                 |         |                                     |                    |  |
| 10Y TREASURY NOTES USA*                 | USD                             | 54      | 5.543.360                           | 18/06/2024         | 15.734   |
|   |                                 |         |                                     | <b>EUR</b>         | <b>15.734</b>  |

\* Der mit diesem Futures-Kontrakt verbundene Makler ist HSBC Bank PLC, London.

# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## Futures (Fortsetzung)

| Basiswert                                   | Anzahl Kontrakte Kauf/(Verkauf) | Währung | Commitment in Währung des Teilfonds | Fälligkeits-termin | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|---|---------------------------------|---------|-------------------------------------|--------------------|--|
| <b>Euro Bond Total Return (Fortsetzung)</b> |                                 |         |                                     |                    |  |
| 10Y BOND FUTURE AUSTRALIA*                  | AUD                             | 37      | 2.601.543                           | 17/06/2024         | (4.816)  |
| EURO BOB*                                   | EUR                             | (50)    | (5.910.750)                         | 06/06/2024         | (16.250)   |
| 2Y TREASURY NOTES USA*                      | USD                             | 51      | 9.658.604                           | 28/06/2024         | (10.515)   |
| EURO OAT*                                   | EUR                             | (50)    | (6.407.750)                         | 06/06/2024         | (17.250)   |
|   |                                 |         |                                     | <b>EUR</b>         | <b>(48.831)</b>  |
| <b>Euro Credit Bond</b>                     |                                 |         |                                     |                    |  |
| EURO BOBL*                                  | EUR                             | (120)   | (14.185.800)                        | 06/06/2024         | (39.000)   |
| EURO OAT*                                   | EUR                             | (100)   | (12.815.500)                        | 06/06/2024         | (34.500)   |
|   |                                 |         |                                     | <b>USD</b>         | <b>(73.500)</b>  |
| <b>ESG Short Duration Credit Bond</b>       |                                 |         |                                     |                    |  |
| 5Y TREASURY NOTES USA*                      | USD                             | 3       | 321.199                             | 28/06/2024         | 387  |
|   |                                 |         |                                     | <b>EUR</b>         | <b>387</b>   |
| <b>GEM Debt Total Return</b>                |                                 |         |                                     |                    |  |
| 5Y TREASURY NOTES USA*                      | USD                             | 19      | 2.034.262                           | 28/06/2024         | 2.746  |
|   |                                 |         |                                     | <b>USD</b>         | <b>2.746</b>   |
| 2Y TREASURY NOTES USA*                      | USD                             | 50      | 10.226.758                          | 28/06/2024         | (11.133)   |
| US 10yr ULTRA*                              | USD                             | (45)    | (5.161.289)                         | 18/06/2024         | (26.601)   |
| US ULTRA BOND*                              | USD                             | (18)    | (2.325.656)                         | 18/06/2024         | (44.719)   |
|   |                                 |         |                                     | <b>USD</b>         | <b>(82.453)</b>  |
| <b>Global Bond</b>                          |                                 |         |                                     |                    |  |
| US 10yr ULTRA*                              | USD                             | (4)     | (458.781)                           | 18/06/2024         | 4.069  |
| 5Y TREASURY NOTES USA*                      | USD                             | 2       | 214.133                             | 28/06/2024         | 586  |
| 10Y TREASURY NOTES USA*                     | USD                             | (6)     | (665.203)                           | 18/06/2024         | 5.485  |
|   |                                 |         |                                     | <b>USD</b>         | <b>10.140</b>  |
| 10Y BOND FUTURE AUSTRALIA*                  | AUD                             | 6       | 455.622                             | 17/06/2024         | (773)  |
| EURO BOBL*                                  | EUR                             | (4)     | (510.689)                           | 06/06/2024         | (724)  |
| EURO BUND*                                  | EUR                             | (7)     | (1.008.164)                         | 06/06/2024         | (3.170)  |
| 2Y TREASURY NOTES USA*                      | USD                             | 2       | 409.070                             | 28/06/2024         | (992)  |
| 10Y BOND FUTURE CANADA*                     | CAD                             | (6)     | (533.671)                           | 19/06/2024         | (3.617)  |
|   |                                 |         |                                     | <b>USD</b>         | <b>(9.276)</b>   |
| <b>Global Bond Total Return</b>             |                                 |         |                                     |                    |  |
| EURO BOBL*                                  | EUR                             | 347     | 44.302.250                          | 06/06/2024         | 162.211  |
| EURO BUND*                                  | EUR                             | 64      | 9.217.497                           | 06/06/2024         | 8.414  |
| LONG GILT*                                  | GBP                             | 19      | 2.399.335                           | 26/06/2024         | 43.804   |
| 2Y TREASURY NOTES USA*                      | USD                             | (14)    | (2.863.492)                         | 28/06/2024         | 1.006  |
| US 10yr ULTRA*                              | USD                             | 245     | 28.100.351                          | 18/06/2024         | 39.024   |
|   |                                 |         |                                     | <b>USD</b>         | <b>254.459</b>   |
| EURO SCHATZ*                                | EUR                             | 36      | 4.109.130                           | 06/06/2024         | (3.651)  |
| 5Y TREASURY NOTES USA*                      | USD                             | 438     | 46.895.085                          | 28/06/2024         | (95.485)   |
| 10Y OSE JGB*                                | JPY                             | (19)    | (18.309.525)                        | 13/06/2024         | (34.259)   |
| 10Y TREASURY NOTES USA*                     | USD                             | 39      | 4.323.820                           | 18/06/2024         | (34.492)   |
|   |                                 |         |                                     | <b>USD</b>         | <b>(167.887)</b>   |

\* Der mit diesem Futures-Kontrakt verbundene Makler ist HSBC Bank PLC, London.

x Der mit diesem Futures-Kontrakt verbundene Makler ist J. P. Morgan Securities LLC, New Jersey.

+ Der mit diesem Futures-Kontrakt verbundene Makler ist Barclays Bank PLC, New York.

# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## Futures (Fortsetzung)

| Basiswert                                     | Anzahl<br>Kontrakte<br>Kauf/(Verkauf) | Währung | Commitment<br>in Währung<br>des Teilfonds | Fälligkeits-<br>termin | Nicht realisierter<br>Gewinn/(Verlust)<br>in der Währung<br>des Teilfonds |
|---|---------------------------------------|---------|---|------------------------|---|
| <b>Global Corporate Bond</b>                  |                                       |         |   |                        |   |
| LONG GILT*                                    | GBP                                   | 142     | 17.931.870                                | 26/06/2024             | 430.238   |
| US LONG BOND <sup>x</sup>                     | USD                                   | 327     | 39.429.047                                | 18/06/2024             | 311.795   |
| 5Y TREASURY NOTES USA <sup>x</sup>            | USD                                   | 2.395   | 256.424.040                               | 28/06/2024             | 182.511   |
| 10Y TREASURY NOTES USA <sup>x</sup>           | USD                                   | 166     | 18.403.954                                | 18/06/2024             | 64.844  |
|   |                                       |         |   | <b>USD</b>             | <b>989.388</b>  |
| EURO BOBL*                                    | EUR                                   | (113)   | (14.426.957)                              | 06/06/2024             | (48.206)  |
| EURO SCHATZ*                                  | EUR                                   | 535     | 61.066.233                                | 06/06/2024             | (21.668)  |
| 2Y TREASURY NOTES USA <sup>x</sup>            | USD                                   | 264     | 53.997.280                                | 28/06/2024             | (62.674)  |
|   |                                       |         |   | <b>USD</b>             | <b>(132.548)</b>  |
| <b>Global Emerging Markets Bond</b>           |                                       |         |   |                        |   |
| US ULTRA BOND*                                | USD                                   | 248     | 32.042.375                                | 18/06/2024             | 322.937   |
| 5Y TREASURY NOTES USA*                        | USD                                   | 811     | 86.830.854                                | 28/06/2024             | 117.214   |
| 10Y TREASURY NOTES USA*                       | USD                                   | 214     | 23.725.579                                | 18/06/2024             | 85.266  |
|   |                                       |         |   | <b>USD</b>             | <b>525.417</b>  |
| US LONG BOND*                                 | USD                                   | (189)   | (22.789.266)                              | 18/06/2024             | (196.187)   |
| 2Y TREASURY NOTES USA*                        | USD                                   | 1.027   | 210.057.599                               | 28/06/2024             | (228.675)   |
| US 10yr ULTRA*                                | USD                                   | (726)   | (83.268.795)                              | 18/06/2024             | (435.662)   |
|   |                                       |         |   | <b>USD</b>             | <b>(860.524)</b>  |
| <b>Global Emerging Markets ESG Bond</b>       |                                       |         |   |                        |   |
| 5Y TREASURY NOTES USA <sup>x</sup>            | USD                                   | 73      | 7.815.848                                 | 28/06/2024             | 11.121  |
| 10Y TREASURY NOTES USA <sup>x</sup>           | USD                                   | 14      | 1.552.141                                 | 18/06/2024             | 5.578   |
|   |                                       |         |   | <b>USD</b>             | <b>16.699</b>   |
| US LONG BOND <sup>x</sup>                     | USD                                   | (8)     | (964.625)                                 | 18/06/2024             | (12.125)  |
| 2Y TREASURY NOTES USA <sup>x</sup>            | USD                                   | 78      | 15.953.742                                | 28/06/2024             | (17.368)  |
| US 10yr ULTRA <sup>x</sup>                    | USD                                   | (49)    | (5.620.070)                               | 18/06/2024             | (28.288)  |
| US ULTRA BOND*                                | USD                                   | (5)     | (646.016)                                 | 18/06/2024             | (3.766)   |
|   |                                       |         |   | <b>USD</b>             | <b>(61.547)</b>   |
| <b>Global Emerging Markets ESG Local Debt</b> |                                       |         |   |                        |   |
| US 10yr ULTRA*                                | USD                                   | 32      | 3.670.250                                 | 18/06/2024             | 18.750  |
|   |                                       |         |   | <b>USD</b>             | <b>18.750</b>   |
| <b>Global Emerging Markets Local Debt</b>     |                                       |         |   |                        |   |
| US 10yr ULTRA*                                | USD                                   | 100     | 11.469.531                                | 18/06/2024             | 58.594  |
|   |                                       |         |   | <b>USD</b>             | <b>58.594</b>   |

\* Der mit diesem Futures-Kontrakt verbundene Makler ist HSBC Bank PLC, London.

<sup>x</sup> Der mit diesem Futures-Kontrakt verbundene Makler ist J. P. Morgan Securities LLC, New Jersey.

<sup>†</sup> Der mit diesem Futures-Kontrakt verbundene Makler ist Barclays Bank PLC, New York.



# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## Futures (Fortsetzung)

| Basiswert                        | Anzahl<br>Kontrakte<br>Kauf/(Verkauf) | Währung | Commitment in<br>Währung des<br>Teilfonds | Fälligkeits-<br>termin | Nicht realisierter<br>Gewinn/(Verlust)<br>in der Währung<br>des Teilfonds |
|----------------------------------|---------------------------------------|---------|---|------------------------|---|
| <b>Global ESG Corporate Bond</b> |                                       |         |   |                        |   |
| EURO SCHATZ*                     | EUR                                   | 45      | 5.137.366                                 | 06/06/2024             | 365   |
| LONG GILT*                       | GBP                                   | 5       | 631.379                                   | 26/06/2024             | 16.706  |
| US LONG BOND*                    | USD                                   | 22      | 2.652.719                                 | 18/06/2024             | 29.906  |
| 5Y TREASURY NOTES USA*           | USD                                   | 146     | 15.631.695                                | 28/06/2024             | 18.820  |
|                                  |                                       |         |   | <b>USD</b>             | <b>65.797</b>   |
| EURO BOBL*                       | EUR                                   | (8)     | (1.021.567)                               | 06/06/2024             | (4.105)   |
| EURO BUND*                       | EUR                                   | (10)    | (1.440.501)                               | 06/06/2024             | (10.640)  |
| 2Y TREASURY NOTES USA*           | USD                                   | 38      | 7.772.336                                 | 28/06/2024             | (9.021)   |
| 10Y TREASURY NOTES USA*          | USD                                   | (45)    | (4.989.024)                               | 18/06/2024             | (13.305)  |
|                                  |                                       |         |   | <b>USD</b>             | <b>(37.071)</b>   |
| <b>Global Government Bond</b>    |                                       |         |   |                        |   |
| LONG GILT*                       | GBP                                   | 696     | 87.891.421                                | 26/06/2024             | 2.325.542   |
| EURO BTP*                        | EUR                                   | 396     | 50.904.608                                | 06/06/2024             | 558.576   |
| US 10yr ULTRA*                   | USD                                   | 1.359   | 155.870.926                               | 18/06/2024             | 397.275   |
| 10Y TREASURY NOTES USA*          | USD                                   | 511     | 56.653.134                                | 18/06/2024             | 159.689   |
|                                  |                                       |         |   | <b>USD</b>             | <b>3.441.082</b>  |
| 10Y BOND FUTURE AUSTRALIA*       | AUD                                   | 180     | 13.668.646                                | 17/06/2024             | (23.195)  |
| EURO BOBL*                       | EUR                                   | (205)   | (26.172.799)                              | 06/06/2024             | (94.095)  |
| EURO BUND*                       | EUR                                   | (653)   | (94.047.273)                              | 06/06/2024             | (757.668)   |
| EURO SCHATZ*                     | EUR                                   | 47      | 5.364.697                                 | 06/06/2024             | (991)   |
| 2Y TREASURY NOTES USA*           | USD                                   | 1.577   | 322.551.932                               | 28/06/2024             | (314.178)   |
| US ULTRA BOND*                   | USD                                   | (308)   | (39.794.563)                              | 18/06/2024             | (293.563)   |
| 10Y BOND FUTURE CANADA*          | CAD                                   | (1.213) | (107.890.445)                             | 19/06/2024             | (669.835)   |
| 5Y TREASURY NOTES USA*           | USD                                   | 653     | 69.914.362                                | 28/06/2024             | (39.309)  |
|                                  |                                       |         |   | <b>USD</b>             | <b>(2.192.834)</b>  |
| <b>Global High Income Bond</b>   |                                       |         |   |                        |   |
| US ULTRA BOND*                   | USD                                   | 14      | 1.808.844                                 | 18/06/2024             | 19.906  |
| 5Y TREASURY NOTES USA**          | USD                                   | 517     | 55.353.331                                | 28/06/2024             | 64.316  |
| 10Y TREASURY NOTES USA*          | USD                                   | 145     | 16.075.743                                | 18/06/2024             | 56.641  |
|                                  |                                       |         |   | <b>USD</b>             | <b>140.863</b>  |
| US LONG BOND*                    | USD                                   | (11)    | (1.326.359)                               | 18/06/2024             | (16.844)  |
| 2Y TREASURY NOTES USA*           | USD                                   | 252     | 51.542.858                                | 28/06/2024             | (56.111)  |
| US 10yr ULTRA*                   | USD                                   | (131)   | (15.025.086)                              | 18/06/2024             | (77.593)  |
|                                  |                                       |         |   | <b>USD</b>             | <b>(150.548)</b>  |
| <b>Global High Yield Bond</b>    |                                       |         |   |                        |   |
| 5Y TREASURY NOTES USA*           | USD                                   | 299     | 32.012.855                                | 28/06/2024             | 38.543  |
| 10Y TREASURY NOTES USA*          | USD                                   | 197     | 21.840.836                                | 18/06/2024             | 76.953  |
|                                  |                                       |         |   | <b>USD</b>             | <b>115.496</b>  |

\* Der mit diesem Futures-Kontrakt verbundene Makler ist HSBC Bank PLC, London.

+ Der mit diesem Futures-Kontrakt verbundene Makler ist Barclays Bank PLC, New York.

x Der mit diesem Futures-Kontrakt verbundene Makler ist J. P. Morgan Securities LLC, New Jersey.

\*\*Die mit diesem Futures-Kontrakt verbundenen Makler sind HSBC Bank PLC, London, und Barclays Bank PLC, New York.

# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## Futures (Fortsetzung)

| Basiswert                           | Anzahl Kontrakte Kauf/(Verkauf) | Währung | Commitment in Währung des Teilfonds | Fälligkeits-termin | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|-------------------------------------|---------------------------------|---------|-------------------------------------|--------------------|--|
| <b>Global High Yield ESG Bond</b>   |                                 |         |                                     |                    |  |
| 5Y TREASURY NOTES USA*              | USD                             | 16      | 1.713.062                           | 28/06/2024         | 4.055  |
| 10Y TREASURY NOTES USA*             | USD                             | 6       | 665.203                             | 18/06/2024         | 2.343  |
|                                     |                                 |         |                                     | <b>USD</b>         | <b>6.398</b>   |
| <b>Global Inflation Linked Bond</b> |                                 |         |                                     |                    |  |
| 10Y TREASURY NOTES USA*             | USD                             | 169     | 18.736.555                          | 18/06/2024         | 52.813   |
|                                     |                                 |         |                                     | <b>USD</b>         | <b>52.813</b>  |
| 10Y BOND FUTURE AUSTRALIA*          | AUD                             | 201     | 15.263.322                          | 17/06/2024         | (25.901)   |
| 2Y TREASURY NOTES USA*              | USD                             | 324     | 66.269.389                          | 28/06/2024         | (64.549)   |
| US 10yr ULTRA*                      | USD                             | (3)     | (344.086)                           | 18/06/2024         | (1.172)  |
| US ULTRA BOND*                      | USD                             | (53)    | (6.847.766)                         | 18/06/2024         | (50.516)   |
| 10Y BOND FUTURE CANADA*             | CAD                             | (72)    | (6.404.050)                         | 19/06/2024         | (43.410)   |
| 10Y OSE JGB*                        | JPY                             | (8)     | (7.709.274)                         | 13/06/2024         | (6.607)  |
|                                     |                                 |         |                                     | <b>USD</b>         | <b>(192.155)</b>   |
| <b>Global Lower Carbon Bond</b>     |                                 |         |                                     |                    |  |
| LONG GILT*                          | GBP                             | 5       | 631.404                             | 26/06/2024         | 16.706   |
| US LONG BOND*                       | USD                             | 24      | 2.893.875                           | 18/06/2024         | 32.625   |
| 5Y TREASURY NOTES USA*              | USD                             | 174     | 18.629.554                          | 28/06/2024         | 32.851   |
| 10Y TREASURY NOTES USA*             | USD                             | 13      | 1.441.273                           | 18/06/2024         | 4.938  |
|                                     |                                 |         |                                     | <b>USD</b>         | <b>87.120</b>  |
| 2Y TREASURY NOTES USA*              | USD                             | 16      | 3.272.562                           | 28/06/2024         | (3.798)  |
|                                     |                                 |         |                                     | <b>USD</b>         | <b>(3.798)</b>   |
| <b>Global Short Duration Bond</b>   |                                 |         |                                     |                    |  |
| 5Y TREASURY NOTES USA*              | USD                             | (1.106) | (118.415.444)                       | 28/06/2024         | 114.306  |
|                                     |                                 |         |                                     | <b>USD</b>         | <b>114.306</b>   |
| EURO BOBL*                          | EUR                             | (390)   | (49.792.154)                        | 06/06/2024         | (100.375)  |
| EURO SCHATZ*                        | EUR                             | 958     | 109.348.506                         | 06/06/2024         | (17.541)   |
| LONG GILT*                          | GBP                             | (107)   | (13.512.043)                        | 26/06/2024         | (276.188)  |
| 2Y TREASURY NOTES USA*              | USD                             | 2.878   | 588.652.162                         | 28/06/2024         | (661.807)  |
| 10Y OSE JGB*                        | JPY                             | (26)    | (25.055.139)                        | 13/06/2024         | (64.092)   |
|                                     |                                 |         |                                     | <b>USD</b>         | <b>(1.120.003)</b>   |
| <b>Ultra Short Duration Bond</b>    |                                 |         |                                     |                    |  |
| 2Y TREASURY NOTES USA*              | USD                             | (140)   | (28.634.921)                        | 28/06/2024         | 31.173   |
|                                     |                                 |         |                                     | <b>USD</b>         | <b>31.173</b>  |
| <b>US Dollar Bond</b>               |                                 |         |                                     |                    |  |
| US LONG BOND*                       | USD                             | 50      | 6.028.906                           | 18/06/2024         | 24.533   |
|                                     |                                 |         |                                     | <b>USD</b>         | <b>24.533</b>  |
| 5Y TREASURY NOTES USA*              | USD                             | 55      | 5.888.652                           | 28/06/2024         | (40.989)   |
|                                     |                                 |         |                                     | <b>USD</b>         | <b>(40.989)</b>  |
| <b>US High Yield Bond</b>           |                                 |         |                                     |                    |  |
| 5Y TREASURY NOTES USA*              | USD                             | 16      | 1.713.062                           | 28/06/2024         | 687  |
| 10Y TREASURY NOTES USA*             | USD                             | 6       | 665.203                             | 18/06/2024         | 2.344  |
|                                     |                                 |         |                                     | <b>USD</b>         | <b>3.031</b>   |

\* Der mit diesem Futures-Kontrakt verbundene Makler ist HSBC Bank PLC, London.

† Der mit diesem Futures-Kontrakt verbundene Makler ist Barclays Bank PLC, New York.

‡ Der mit diesem Futures-Kontrakt verbundene Makler ist J. P. Morgan Securities LLC, New Jersey.

# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## Futures (Fortsetzung)

| Basiswert  | Anzahl Kontrakte Kauf/(Verkauf) | Währung | Commitment in Währung des Teilfonds | Fälligkeits-termin | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|--|---------------------------------|---------|-------------------------------------|--------------------|--|
| <b>Global Emerging Markets Multi-Asset Income</b>    |                                 |         |                                     |                    |  |
| MSCI EMERGING MKT INDEX*                             | USD                             | 3       | 157.628                             | 21/06/2024         | 407  |
| 5Y TREASURY NOTES USA*                               | USD                             | 20      | 2.141.328                           | 28/06/2024         | 2.891  |
| 10Y TREASURY NOTES USA*                              | USD                             | 3       | 332.602                             | 18/06/2024         | 1.195  |
|  |                                 |         |                                     | <b>USD</b>         | <b>4.493</b>   |
| US LONG BOND*  | USD                             | (4)     | (482.313)                           | 18/06/2024         | (6.125)  |
| 2Y TREASURY NOTES USA*                               | USD                             | 13      | 2.658.957                           | 28/06/2024         | (2.894)  |
| US 10yr ULTRA*                                       | USD                             | (3)     | (344.086)                           | 18/06/2024         | (1.774)  |
| US ULTRA BOND*                                       | USD                             | 2       | 258.406                             | 18/06/2024         | (125)  |
| MSCI INDIA INDEX*                                    | USD                             | 3       | 365.475                             | 21/06/2024         | (2.997)  |
|  |                                 |         |                                     | <b>USD</b>         | <b>(13.915)</b>  |
| <b>Managed Solutions – Asia Focused Conservative</b> |                                 |         |                                     |                    |  |
| US LONG BOND*  | USD                             | 1       | 120.578                             | 18/06/2024         | 1.609  |
| US 10yr ULTRA*                                       | USD                             | 3       | 344.086                             | 18/06/2024         | 1.625  |
| TOPIX INDEX (TOKYO)*                                 | JPY                             | 1       | 182.646                             | 13/06/2024         | 4.212  |
| FTSE TAIWAN INDEX*                                   | USD                             | 6       | 415.050                             | 29/04/2024         | 510  |
| THAI SET 50 INDEX*                                   | THB                             | (53)    | (242.039)                           | 27/06/2024         | 1.055  |
|  |                                 |         |                                     | <b>USD</b>         | <b>9.011</b>   |
| MSCI PHILIPPINES INDEX*                              | USD                             | 11      | 252.120                             | 21/06/2024         | (601)  |
|  |                                 |         |                                     | <b>USD</b>         | <b>(601)</b>   |
| <b>Managed Solutions – Asia Focused Growth</b>       |                                 |         |                                     |                    |  |
| US LONG BOND*  | USD                             | 2       | 241.156                             | 18/06/2024         | 2.578  |
| TOPIX INDEX (TOKYO)*                                 | JPY                             | 1       | 182.646                             | 13/06/2024         | 4.212  |
| FTSE TAIWAN INDEX*                                   | USD                             | 5       | 345.875                             | 29/04/2024         | 425  |
| THAI SET 50 INDEX*                                   | THB                             | (43)    | (196.371)                           | 27/06/2024         | 856  |
|  |                                 |         |                                     | <b>USD</b>         | <b>8.071</b>   |
| MSCI PHILIPPINES INDEX*                              | USD                             | 9       | 206.280                             | 21/06/2024         | (492)  |
|  |                                 |         |                                     | <b>USD</b>         | <b>(492)</b>   |
| <b>Managed Solutions – Asia Focused Income</b>       |                                 |         |                                     |                    |  |
| US LONG BOND*  | USD                             | 17      | 2.049.828                           | 18/06/2024         | 20.953   |
| US 10yr ULTRA*                                       | USD                             | 19      | 2.179.211                           | 18/06/2024         | 8.203  |
| US ULTRA BOND*                                       | USD                             | 2       | 258.406                             | 18/06/2024         | 3.344  |
| TOPIX INDEX (TOKYO)*                                 | JPY                             | 13      | 2.374.393                           | 13/06/2024         | 54.695   |
| FTSE TAIWAN INDEX*                                   | USD                             | 71      | 4.911.425                           | 29/04/2024         | 5.995  |
| THAI SET 50 INDEX*                                   | THB                             | (593)   | (2.708.094)                         | 27/06/2024         | 11.798   |
|  |                                 |         |                                     | <b>USD</b>         | <b>104.988</b>   |
| MSCI PHILIPPINES INDEX*                              | USD                             | 120     | 2.750.400                           | 21/06/2024         | (12.073)   |
|  |                                 |         |                                     | <b>USD</b>         | <b>(12.073)</b>  |
| <b>Multi-Asset Style Factors</b>                     |                                 |         |                                     |                    |  |
| EURO SCHATZ*   | EUR                             | (876)   | (92.582.250)                        | 06/06/2024         | 44.965   |
| LONG GILT^   | GBP                             | 795     | 92.956.653                          | 26/06/2024         | 1.511.074  |
| US 10yr ULTRA^                                       | USD                             | 1.424   | 151.227.890                         | 18/06/2024         | 680.914  |

\* Der mit diesem Futures-Kontrakt verbundene Makler ist HSBC Bank PLC, London.

+ Der mit diesem Futures-Kontrakt verbundene Makler ist Barclays Bank PLC, New York.

x Der mit diesem Futures-Kontrakt verbundene Makler ist J. P. Morgan Securities LLC, New Jersey.

^ Der mit diesem Futures-Kontrakt verbundene Makler ist Societe Generale International LTD.

# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## Futures (Fortsetzung)

| Basiswert                                      | Anzahl<br>Kontrakte<br>Kauf/(Verkauf) | Währung | Commitment in<br>Währung des<br>Teilfonds | Fälligkeits-<br>termin | Nicht realisierter<br>Gewinn/(Verlust)<br>in der Währung<br>des Teilfonds |                     |
|--|---------------------------------------|---------|---|------------------------|---|---------------------|
| <b>Multi-Asset Style Factors (Fortsetzung)</b> |                                       |         |   |                        |   |                     |
| CME S&P500 EMINI FUT <sup>^</sup>              |                                       | USD     | 112                                       | 27.557.315             | 21/06/2024  | 595.479             |
| FTSE 100 INDEX <sup>^</sup>                    |                                       | GBP     | 666                                       | 62.250.198             | 21/06/2024  | 2.494.093           |
| MEXICO BOLSA INDEX <sup>^</sup>                |                                       | MXN     | 182                                       | 5.897.781              | 21/06/2024  | 228.875             |
| SWISS MARKET INDEX <sup>^</sup>                |                                       | CHF     | 707                                       | 84.512.416             | 21/06/2024  | 836.767             |
| S&P 500 EMINI INDEX <sup>^</sup>               |                                       | USD     | 64  | 6.410.741              | 21/06/2024  | 148.437             |
| EUREX STOXX 600*                               |                                       | EUR     | 3.696                                     | 70.152.888             | 21/06/2024  | 1.461.568           |
| XAF FINANCIAL <sup>^</sup>                     |                                       | USD     | 60  | 7.279.861              | 21/06/2024  | 244.479             |
| XAI EMINI INDUSTRY <sup>^</sup>                |                                       | USD     | 37  | 4.401.630              | 21/06/2024  | 131.556             |
| XAE ENERGY <sup>^</sup>                        |                                       | USD     | 184                                       | 16.968.889             | 21/06/2024  | 1.150.000           |
| XAP CONS STAPLES <sup>^</sup>                  |                                       | USD     | 136                                       | 9.801.444              | 21/06/2024  | 181.602             |
| XAK TECHNOLOGY <sup>^</sup>                    |                                       | USD     | 13  | 2.560.639              | 21/06/2024  | 7.102               |
| XAY CONS DISCRET <sup>^</sup>                  |                                       | USD     | 28  | 4.886.519              | 21/06/2024  | 98.843              |
| FTSE/MIB INDEX*                                |                                       | EUR     | 629                                       | 107.598.313            | 21/06/2024  | 4.823.532           |
| OMX STOCKHOLM 30 INDEX <sup>^</sup>            |                                       | SEK     | 3.029                                     | 66.593.757             | 19/04/2024  | 2.148.811           |
| IBEX 35 INDEX*                                 |                                       | EUR     | 555                                       | 61.374.675             | 19/04/2024  | 4.358.138           |
| 10Y BOND FUTURE KOREA <sup>^</sup>             |                                       | KRW     | 2.420                                     | 189.054.438            | 18/06/2024  | 711.496             |
| FTSE KLCI <sup>^</sup>                         |                                       | MYR     | (815)                                     | (12.227.057)           | 30.04.2024  | 29.895              |
| THAI SET 50 INDEX <sup>^</sup>                 |                                       | THB     | (7.799)                                   | (32.977.995)           | 27/06/2024  | 198.026             |
| WIG20 INDEX <sup>^</sup>                       |                                       | PLN     | 2.868                                     | 32.397.412             | 21/06/2024  | 993.719             |
| 5Y TREASURY NOTES USA <sup>^</sup>             |                                       | USD     | (114)                                     | (11.301.454)           | 28/06/2024  | 7.574               |
| Nifty 50 Futures <sup>^</sup>                  |                                       | USD     | 190                                       | 7.940.329              | 25/04/2024  | 95.401              |
|  |                                       |         |   | <b>USD</b>             |   | <b>23.182.346</b>   |
| 10Y BOND FUTURE AUSTRALIA <sup>^</sup>         |                                       | AUD     | (593)                                     | (41.695.001)           | 17/06/2024  | (102.628)           |
| EURO BOBL*                                     |                                       | EUR     | (82)                                      | (9.693.630)            | 06/06/2024  | (23.860)            |
| EURO BUND*                                     |                                       | EUR     | (1.197)                                   | (159.625.935)          | 06/06/2024  | (972.545)           |
| FTSE/JSE TOP40 <sup>^</sup>                    |                                       | ZAR     | (80)                                      | (2.696.083)            | 20/06/2024  | (47.210)            |
| KOREA KOSPI 2 INDEX <sup>^</sup>               |                                       | KRW     | (274)                                     | (17.701.546)           | 13/06/2024  | (650.151)           |
| DAX MINI*                                      |                                       | EUR     | (138)                                     | (64.753.050)           | 21/06/2024  | (2.656.075)         |
| S&P INDICES S&P/TSX 60 INDEX <sup>^</sup>      |                                       | CAD     | (303)                                     | (55.688.179)           | 20/06/2024  | (967.822)           |
| SPI 200 <sup>^</sup>                           |                                       | AUD     | (593)                                     | (71.213.331)           | 20/06/2024  | (2.021.896)         |
| EUREX STOXX 600*                               |                                       | EUR     | (1.905)                                   | (59.713.512)           | 21/06/2024  | (3.181.599)         |
| XAV HEALTH CARE <sup>^</sup>                   |                                       | USD     | (121)                                     | (16.950.644)           | 21/06/2024  | (209.634)           |
| XAB MATERIALS <sup>^</sup>                     |                                       | USD     | (171)                                     | (15.762.083)           | 21/06/2024  | (566.315)           |
| XAU UTILITIES <sup>^</sup>                     |                                       | USD     | (173)                                     | (10.666.731)           | 21/06/2024  | (333.315)           |
| TOPIX INDEX (TOKYO) <sup>^</sup>               |                                       | JPY     | (368)                                     | (62.234.801)           | 13/06/2024  | (1.644.055)         |
| 10Y BOND FUTURE CANADA <sup>^</sup>            |                                       | CAD     | (272)                                     | (22.400.996)           | 19/06/2024  | (10.886)            |
| CAC40 10 EURO*                                 |                                       | EUR     | (1.192)                                   | (98.092.660)           | 19/04/2024  | (2.379.405)         |
| FTSE TAIWAN INDEX <sup>^</sup>                 |                                       | USD     | (128)                                     | (8.198.519)            | 29/04/2024  | (31.407)            |
| H SHARES CHINA ENTERPRISE IDX <sup>^</sup>     |                                       | HKD     | (60)                                      | (2.078.600)            | 29/04/2024  | (29.636)            |
| BOVESPA INDEX <sup>^</sup>                     |                                       | BRL     | 1.410                                     | 33.611.427             | 17/04/2024  | (223.095)           |
|  |                                       |         |   | <b>USD</b>             |   | <b>(16.051.534)</b> |

<sup>^</sup> Der mit diesem Futures-Kontrakt verbundene Makler ist Societe Generale International LTD.

\* Der mit diesem Futures-Kontrakt verbundene Makler ist HSBC Bank PLC, London.

# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## Futures (Fortsetzung)

| Basiswert                           | Anzahl<br>Kontrakte<br>Kauf/(Verkauf) | Währung | Commitment in<br>Währung des<br>Teilfonds | Fälligkeits-<br>termin | Nicht realisierter<br>Gewinn/(Verlust)<br>in der Währung<br>des Teilfonds |
|-------------------------------------|---------------------------------------|---------|---|------------------------|---|
| <b>Multi-Strategy Target Return</b> |                                       |         |   |                        |   |
| 10Y BOND FUTURE AUSTRALIA*          | AUD                                   | 52      | 3.656.223                                 | 17/06/2024             | 15.751  |
| EURO SCHATZ*                        | EUR                                   | (189)   | (19.974.938)                              | 06/06/2024             | 9.393   |
| LONG GILT*                          | GBP                                   | 52      | 6.080.184                                 | 26/06/2024             | 85.784  |
| US 10yr ULTRA*                      | USD                                   | 227     | 24.107.255                                | 18/06/2024             | 41.029  |
| CME S&P500 EMINI FUT*               | USD                                   | 65      | 15.993.084                                | 21/06/2024             | 353.177   |
| EURO STOXX 50*                      | EUR                                   | 22      | 1.110.010                                 | 21/06/2024             | 35.200  |
| FTSE 100 INDEX*                     | GBP                                   | 36      | 3.364.876                                 | 21/06/2024             | 128.220   |
| MEXICO BOLSA INDEX*                 | MXN                                   | 15      | 486.081                                   | 21/06/2024             | 20.484  |
| SWISS MARKET INDEX*                 | CHF                                   | 67      | 8.008.956                                 | 21/06/2024             | 85.170  |
| S&P 500 EMINI INDEX*                | USD                                   | 11      | 1.101.846                                 | 21/06/2024             | 28.455  |
| EUREX STOXX 600*                    | EUR                                   | 347     | 6.309.336                                 | 21/06/2024             | 163.359   |
| XAF FINANCIAL*                      | USD                                   | 2       | 242.662                                   | 21/06/2024             | 8.380   |
| XAI EMINI INDUSTRY*                 | USD                                   | 1       | 118.963                                   | 21/06/2024             | 3.555   |
| XAE ENERGY*                         | USD                                   | 19      | 1.752.222                                 | 21/06/2024             | 118.750   |
| XAP CONS STAPLES*                   | USD                                   | 23      | 1.657.597                                 | 21/06/2024             | 30.384  |
| XAK TECHNOLOGY*                     | USD                                   | 2       | 393.944                                   | 21/06/2024             | 1.796   |
| TOPIX INDEX (TOKYO)*                | JPY                                   | 23      | 3.889.675                                 | 13/06/2024             | 119.371   |
| FTSE/MIB INDEX*                     | EUR                                   | 40      | 6.842.500                                 | 21/06/2024             | 300.130   |
| OMX STOCKHOLH 30 INDEX*             | SEK                                   | 332     | 7.299.151                                 | 19/04/2024             | 237.295   |
| IBEX 35 INDEX*                      | EUR                                   | 37      | 4.091.645                                 | 19/04/2024             | 290.543   |
| FTSE TAIWAN INDEX*                  | USD                                   | 29      | 1.857.477                                 | 29/04/2024             | 7.384   |
| 10Y BOND FUTURE KOREA*              | KRW                                   | 144     | 11.249.520                                | 18/06/2024             | 34.169  |
| H SHARES CHINA ENTERPRISE IDX*      | HKD                                   | 30      | 1.039.300                                 | 29/04/2024             | 13.067  |
| THAI SET 50 INDEX*                  | THB                                   | (807)   | (3.412.392)                               | 27/06/2024             | 20.603  |
| WIG20 INDEX^                        | PLN                                   | 292     | 3.298.481                                 | 21/06/2024             | 97.084  |
| EURO BUXL 30YEAR BND*               | EUR                                   | 14      | 1.900.080                                 | 06/06/2024             | 1.680   |
| BIST 30*                            | TRY                                   | 55      | 158.972                                   | 30.04.2024             | 993   |
| Nifty 50 Futures*                   | USD                                   | 91      | 3.803.000                                 | 25/04/2024             | 45.860  |
| VSTOXX*                             | EUR                                   | 100     | 163.000                                   | 17/07/2024             | 420   |
|                                     |                                       |         |   | <b>USD</b>             | <b>2.297.486</b>  |
| EURO BOBL*                          | EUR                                   | (23)    | (2.718.945)                               | 06/06/2024             | (2.375)   |
| EURO BUND*                          | EUR                                   | (95)    | (12.668.725)                              | 06/06/2024             | (78.645)  |
| EURO BTP*                           | EUR                                   | (47)    | (4.976.595)                               | 06/06/2024             | (8.695)   |
| MSCI EMERGING MKT INDEX*            | USD                                   | (63)    | (3.064.979)                               | 21/06/2024             | (5.206)   |
| 2Y TREASURY NOTES USA*              | USD                                   | (28)    | (5.302.763)                               | 28/06/2024             | (622)   |
| US ULTRA BOND*                      | USD                                   | 20      | 2.392.650                                 | 18/06/2024             | (12.442)  |
| FTSE/JSE TOP40*                     | ZAR                                   | (46)    | (1.550.248)                               | 20/06/2024             | (29.714)  |
| KOREA KOSPI 2 INDEX*                | KRW                                   | (5)     | (323.021)                                 | 13/06/2024             | (9.951)   |
| S&P INDICES S&P/TSX 60 INDEX*       | CAD                                   | (26)    | (4.778.524)                               | 20/06/2024             | (81.900)  |
| SPI 200*                            | AUD                                   | (43)    | (5.163.867)                               | 20/06/2024             | (146.700)   |
| EUREX STOXX 600*                    | EUR                                   | (146)   | (5.122.114)                               | 21/06/2024             | (381.308)   |

\* Der mit diesem Futures-Kontrakt verbundene Makler ist HSBC Bank PLC, London.

^ Der mit diesem Futures-Kontrakt verbundene Makler ist Societe Generale International LTD.

# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## Futures (Fortsetzung)

| Basiswert   | Anzahl<br>Kontrakte<br>Kauf/(Verkauf) | Währung | Commitment in<br>Währung des<br>Teilfonds | Fälligkeits-<br>termin | Nicht realisierter<br>Gewinn/(Verlust)<br>in der Währung<br>des Teilfonds |
|---|---------------------------------------|---------|---|------------------------|---|
| <b>Multi-Strategy Target Return (Fortsetzung)</b> |                                       |         |   |                        |   |
| XAV HEALTH CARE*                                  | USD                                   | (7)     | (980.616)                                 | 21/06/2024             | (14.403)  |
| XAB MATERIALS*                                    | USD                                   | (15)    | (1.382.639)                               | 21/06/2024             | (49.491)  |
| XAU UTILITIES*                                    | USD                                   | (18)    | (1.109.833)                               | 21/06/2024             | (34.750)  |
| XAY CONS DISCRET*                                 | USD                                   | (1)     | (174.519)                                 | 21/06/2024             | (3.657)   |
| CAC40 10 EURO*                                    | EUR                                   | (79)    | (6.501.108)                               | 19/04/2024             | (146.937)   |
| FTSE KLCI*  | MYR                                   | 19      | 285.048                                   | 30.04.2024             | (697)   |
| DAX MINI*   | EUR                                   | (61)    | (5.724.545)                               | 21/06/2024             | (181.090)   |
| 5Y TREASURY NOTES USA*                            | USD                                   | (103)   | (10.210.963)                              | 28/06/2024             | (14.124)  |
| BOVESPA INDEX^                                    | BRL                                   | 150     | 3.575.684                                 | 17/04/2024             | (32.020)  |
| VSTOXX*   | EUR                                   | (100)   | (159.750)                                 | 19/06/2024             | (750)   |
|   |                                       |         |   | <b>USD</b>             | <b>(1.235.477)</b>  |
| <b>US Income Focused</b>                          |                                       |         |   |                        |   |
| US LONG BOND*                                     | USD                                   | 4       | 482.313                                   | 18/06/2024             | 5.469   |
| CME S&P500 EMINI FUT*                             | USD                                   | 16      | 4.251.700                                 | 21/06/2024             | 55.263  |
| US REAL ESTATE*                                   | USD                                   | 32      | 1.114.080                                 | 21/06/2024             | 8.840   |
| 5Y TREASURY NOTES USA*                            | USD                                   | 80      | 8.565.312                                 | 28/06/2024             | 5.109   |
| 10Y TREASURY NOTES USA*                           | USD                                   | 9       | 997.805                                   | 18/06/2024             | 3.445   |
|   |                                       |         |   | <b>USD</b>             | <b>78.126</b>   |

\* Der mit diesem Futures-Kontrakt verbundene Makler ist HSBC Bank PLC, London.

x Der mit diesem Futures-Kontrakt verbundene Makler ist J. P. Morgan Securities LLC, New Jersey.

^ Der mit diesem Futures-Kontrakt verbundene Makler ist Societe Generale International LTD.

# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## Swaps

Am 31. März 2024 hat die Gesellschaft die folgenden Zinsswaps und Credit Default Swaps abgeschlossen:

### Asia Bond

#### Credit Default Swaps

| Kontrahent            | Währung | Fälligkeits-termin | Kapitalzusage in Teilfondswährung USD | Basistitel          | Zugrunde liegende ISIN/Bloomberg-Ticker | Netto-nenn-betrag | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|-----------------------|---------|--------------------|---------------------------------------|---------------------|---|-------------------|--|
| BNP PARIBAS, NEW-YORK | USD     | 20/12/2028         | -                                     | CDX.EM.IG Series 40 | 1D765YAA9                               | 4.500.000         | (53.826)   |
|                       |         |                    |                                       |                     |   | USD               | (53.826)   |

### Asia High Yield Bond

#### Credit Default Swaps

| Kontrahent            | Währung | Fälligkeits-termin | Kapitalzusage in Teilfondswährung USD | Basistitel          | Zugrunde liegende ISIN/Bloomberg-Ticker | Netto-nenn-betrag | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|-----------------------|---------|--------------------|---------------------------------------|---------------------|---|-------------------|--|
| BNP PARIBAS, NEW-YORK | USD     | 20/12/2028         | -                                     | CDX.EM.IG Series 40 | 1D765YAA9                               | 10.500.000        | (125.594)  |
|                       |         |                    |                                       |                     |   | USD               | (125.594)  |

### GEM Debt Total Return

#### Zinsswaps

| Kontrahent         | Währung | Fälligkeits-termin | Payer-Zinssatz             | Receiver-Zinssatz         | Kapitalzusage in Währung des Instruments | Netto-nenn-betrag | Nicht realisierter Verlust in der Währung des Teilfonds |
|--------------------|---------|--------------------|----------------------------|---------------------------|--|-------------------|---|
| J.P MORGAN, LONDON | PLN     | 06/03/2029         | 0                          | Floating (WIBOR6M Index)* | 29.908.143                               | 7.500.000         | 16.221  |
|                    |         |                    |                            |                           |  | USD               | 16.221  |
| J.P MORGAN, LONDON | MXN     | 17/02/2027         | Floating (MXIBTIE Index)*  | 9,260 %                   | 897.574.051                              | 54.000.000        | (3.822)   |
| CITIBANK           | BRL     | 02/01/2029         | Floating (BZDIOVRA Index)* | 10,220 %                  | 46.875.842                               | 9.364.772         | (21.596)  |
|                    |         |                    |                            |                           |  | USD               | (25.418)  |

\* Bei den angegebenen variablen Zinssätzen handelt es sich um die zum Ende des Geschäftsjahres geltenden Werte.

### GEM Debt Total Return

#### Credit Default Swaps

| Kontrahent         | Währung | Fälligkeits-termin | Kapitalzusage in Teilfondswährung EUR | Basistitel                      | Zugrunde liegende ISIN/Bloomberg-Ticker | Netto-nenn-betrag | Nicht realisierter Verlust in der Währung des Teilfonds |
|--------------------|---------|--------------------|---------------------------------------|---------------------------------|---|-------------------|---|
| BARCLAYS BANK, PLC | USD     | 20/06/2029         | -                                     | Republik Südafrika              | US836205AR58                            | 4.000.000         | 8.419   |
|                    |         |                    |                                       |                                 |   | USD               | 8.419   |
| J.P MORGAN, LONDON | USD     | 20/06/2029         | -                                     | Königreich Saudi-Arabien        | XS1791937441                            | 5.000.000         | (4.536)   |
| J.P MORGAN, LONDON | USD     | 20/06/2029         | -                                     | Bundesrepublik Brasilien        | US105756BV13                            | 4.993.000         | (18.401)  |
| J.P MORGAN, LONDON | USD     | 20/06/2029         | -                                     | Vereinigte Mexikanische Staaten | US91087BAC46                            | 7.510.000         | (11.790)  |
| J.P MORGAN, LONDON | USD     | 20/06/2029         | -                                     | Republik Chile                  | US168863CF36                            | 3.981.000         | (3.092)   |
|                    |         |                    |                                       |                                 |   | USD               | (37.819)  |

### Global Bond

#### Zinsswaps

| Kontrahent         | Währung | Fälligkeits-termin | Payer-Zinssatz          | Receiver-Zinssatz | Kapitalzusage in Währung des Instruments | Netto-nenn-betrag | Nicht realisierter Verlust in der Währung des Teilfonds |
|--------------------|---------|--------------------|-------------------------|-------------------|--|-------------------|---|
| J.P MORGAN, LONDON | EUR     | 26/05/2032         | Floating (LIBOR Index)* | 1,68 %            | 777.778                                  | 840.000           | (72.633)  |
|                    |         |                    |                         |                   |  | USD               | (72.633)  |

\* Bei den angegebenen variablen Zinssätzen handelt es sich um die zum Ende des Geschäftsjahres geltenden Werte.

### Global Corporate Bond

#### Credit Default Swaps

| Kontrahent         | Währung | Fälligkeits-termin | Kapitalzusage in Teilfondswährung USD | Basistitel          | Zugrunde liegende ISIN/Bloomberg-Ticker | Netto-nenn-betrag | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|--------------------|---------|--------------------|---------------------------------------|---------------------|---|-------------------|--|
| BARCLAYS BANK, PLC | USD     | 20/06/2027         | -                                     | CDX.NA.IG Series 38 | 2165BYEA9                               | 3.000.000         | (35.559)   |
|                    |         |                    |                                       |                     |   | USD               | (35.559)   |

# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## Swaps (Fortsetzung)

### Global Emerging Markets Bond

#### Credit Default Swaps

| Kontrahent         | Währung | Fälligkeits-termin | Kapitalzusage in Teilfondswährung USD | Basistitel         | Zugrunde liegende ISIN/Bloomberg-Ticker | Netto-nenn-betrag | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|--------------------|---------|--------------------|---------------------------------------|--------------------|---|-------------------|--|
| J.P MORGAN, LONDON | USD     | 20/06/2029         | -                                     | Republik Südafrika | US836205AR58                            | 13.000.000        | 27.359   |
|                    |         |                    |                                       |                    |   | <b>USD</b>        | <b>27.359</b>  |
| J.P MORGAN, LONDON | USD     | 20/06/2029         | -                                     | Republik Kolumbien | US195325BB02                            | 14.000.000        | (57.054)   |
| J.P MORGAN, LONDON | USD     | 20/06/2029         | -                                     | Republik Türkei    | US900123AL40                            | 18.010.000        | (173.418)  |
| BARCLAYS BANK, PLC | USD     | 20/06/2029         | -                                     | CDX.EM Series 41   | 2165BZFF4                               | 25.880.000        | -  |
|                    |         |                    |                                       |                    |   | <b>USD</b>        | <b>(230.472)</b>   |

### Global Emerging Markets ESG Bond

#### Credit Default Swaps

| Kontrahent         | Währung | Fälligkeits-termin | Kapitalzusage in Teilfondswährung USD | Basistitel         | Zugrunde liegende ISIN/Bloomberg-Ticker | Netto-nenn-betrag | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|--------------------|---------|--------------------|---------------------------------------|--------------------|---|-------------------|--|
| J.P MORGAN, LONDON | USD     | 20/06/2029         | -                                     | Republik Südafrika | US836205AR58                            | 130.000           | 273  |
|                    |         |                    |                                       |                    |   | <b>USD</b>        | <b>273</b>   |
| J.P MORGAN, LONDON | USD     | 20/06/2029         | -                                     | Republik Kolumbien | US195325BB02                            | 600.000           | (2.445)  |
| J.P MORGAN, LONDON | USD     | 20/06/2029         | -                                     | Republik Türkei    | US900123AL40                            | 1.130.000         | (10.881)   |
| J.P MORGAN, LONDON | USD     | 20/06/2029         | -                                     | CDX.EM Series 41   | 2165BZFF4                               | 580.000           | -  |
|                    |         |                    |                                       |                    |   | <b>USD</b>        | <b>(13.326)</b>  |

### Global Emerging Markets ESG Local Debt

#### Zinsswaps

| Kontrahent         | Währung | Fälligkeits-termin | Payer-Zinssatz             | Receiver-Zinssatz         | Kapitalzusage in Währung des Instruments | Netto-nenn-betrag | Nicht realisierter Verlust in der Währung des Teilfonds |
|--------------------|---------|--------------------|----------------------------|---------------------------|--|-------------------|---|
| J.P MORGAN, LONDON | CZK     | 14/12/2025         | Floating (PRIBOR6M Index)* | 4,603 %                   | 4.073.862.304                            | 174.000.000       | 51.482  |
| J.P MORGAN, LONDON | PLN     | 06/03/2029         | 4,78 %                     | Floating (WIBOR6M Index)* | 49.448.094                               | <b>12.400.000</b> | <b>26.819</b>   |
| J.P MORGAN, LONDON | ZAR     | 20/07/2032         | 9,26 %                     | Floating (JIBA3M Index)*  | 113.617.792                              | 6.000.000         | 3.209   |
| J.P MORGAN, LONDON | MXN     | 21/12/2033         | 8,52 %                     | Floating (MXIBTIE Index)* | 631.626.576                              | <b>38.000.000</b> | <b>33.938</b>   |
|                    |         |                    |                            |                           |  | <b>USD</b>        | <b>115.448</b>  |

\* Bei den angegebenen variablen Zinssätzen handelt es sich um die zum Ende des Geschäftsjahres geltenden Werte.

### Global Emerging Markets Local Debt

#### Zinsswaps

| Kontrahent         | Währung | Fälligkeits-termin | Payer-Zinssatz             | Receiver-Zinssatz          | Kapitalzusage in Währung des Instruments | Netto-nenn-betrag | Nicht realisierter Gewinn in Teilfondswährung |
|--------------------|---------|--------------------|----------------------------|----------------------------|--|-------------------|---|
| J.P MORGAN, LONDON | CZK     | 14/12/2025         | Floating (PRIBOR6M Index)* | 4,603 %                    | 17.349.033.099                           | 741.000.000       | 219.246                                       |
| J.P MORGAN, LONDON | ZAR     | 22/06/2027         | 7,83 %                     | Floating (JIBA3M Index)*   | 2.840.437.480                            | 150.000.000       | 85.892  |
| J.P MORGAN, LONDON | PLN     | 06/03/2029         | 4,78 %                     | Floating (WIBOR6M Index)*  | 178.252.417                              | 44.700.000        | 96.678  |
| BARCLAYS BANK, PLC | CZK     | 16/12/2031         | 2,87 %                     | Floating (PRIBOR6M Index)* | 1.030.172.004                            | 44.000.000        | 104.003                                       |
| J.P MORGAN, LONDON | MXN     | 21/12/2033         | 8,52 %                     | Floating (MXIBTIE Index)*  | 1.996.272.235                            | 120.100.000       | 107.261                                       |
|                    |         |                    |                            |                            |  | <b>USD</b>        | <b>613.080</b>                                |

\* Bei den angegebenen variablen Zinssätzen handelt es sich um die zum Ende des Geschäftsjahres geltenden Werte.



# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## Swaps (Fortsetzung)

### Global Government Bond

#### Zinsswaps

| Kontrahent         | Währung | Fälligkeits-termin | Payer-Zinssatz             | Receiver-Zinssatz | Kapitalzusage in Währung des Instruments | Netto-nenn-betrag | Nicht realisierter Verlust in der Währung des Teilfonds |
|--------------------|---------|--------------------|----------------------------|-------------------|--|-------------------|---|
| J.P MORGAN, LONDON | EUR     | 26/05/2032         | Floating (LIBOR Index)*    | 1,683 %           | 54.351.856                               | 58.700.000        | (5.075.652)   |
| J.P MORGAN, LONDON | NZD     | 28/03/2033         | Floating (NFIX3FRA Index)* | 4,100 %           | 60.000.000                               | 60.000.000        | (407.558)   |
| UBS AG             | NZD     | 31/03/2033         | Floating (NFIX3FRA Index)* | 4,203 %           | 100.309.260                              | 60.000.000        | (371.927)   |
|                    |         |                    |                            |                   |  | <b>USD</b>        | <b>(5.855.137)</b>                                      |

\* Bei den angegebenen variablen Zinssätzen handelt es sich um die zum Ende des Geschäftsjahres geltenden Werte.

### Global High Income Bond

#### Credit Default Swaps

| Kontrahent         | Währung | Fälligkeits-termin | Kapitalzusage in Teilfondswährung USD | Basistitel                        | Zugrunde liegende ISIN/Bloomberg-Ticker | Netto-nenn-betrag | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|--------------------|---------|--------------------|---------------------------------------|-----------------------------------|---|-------------------|--|
| BARCLAYS BANK, PLC | USD     | 20/06/2027         | (3.577.000)                           | CDX.EM Series 37                  | 2165BZEZ1                               | (3.577.000)       | 357.726  |
| BARCLAYS BANK, PLC | USD     | 20/12/2027         | (260.000)                             | Republik Südafrika                | US836205AR58                            | (260.000)         | 11.977   |
| J.P MORGAN, LONDON | USD     | 20/06/2029         | -                                     | Republik Südafrika                | US836205AR58                            | 4.565.000         | 9.607  |
|                    |         |                    |                                       |                                   |   | <b>USD</b>        | <b>379.310</b>   |
| BARCLAYS BANK, PLC | USD     | 20/12/2025         | -                                     | Republik Südafrika                | US836205AR58                            | 4.536.000         | (351.761)  |
| BARCLAYS BANK, PLC | EUR     | 20/12/2027         | -                                     | ITRAXX EUROPE CROSSOVER SERIES 38 | 21667KJQ2                               | 12.333.250        | (614.577)  |
| J.P MORGAN, LONDON | USD     | 20/12/2028         | -                                     | CDX.NA.HY Series 41               | 2165BRAB1                               | 14.004.540        | (313.858)  |
| J.P MORGAN, LONDON | USD     | 20/12/2028         | -                                     | Bundesrepublik Brasilien          | US105756BV13                            | 3.000.000         | (30.826)   |
| J.P MORGAN, LONDON | USD     | 20/06/2029         | -                                     | Sultanat Oman                     | XS1405777589                            | 3.000.000         | (45.972)   |
| J.P MORGAN, LONDON | USD     | 20/06/2029         | -                                     | Republik Kolumbien                | US195325BB02                            | 5.945.000         | (24.228)   |
| J.P MORGAN, LONDON | USD     | 20/06/2029         | -                                     | Republik Türkei                   | US900123AL40                            | 5.880.000         | (56.618)   |
| J.P MORGAN, LONDON | USD     | 20/06/2029         | -                                     | CDX.EM Series 41                  | 2165BZF4                                | 3.940.000         | -  |
| J.P MORGAN, LONDON | USD     | 20/06/2029         | -                                     | Bundesrepublik Brasilien          | US105756BV13                            | 3.920.000         | (9.365)  |
| J.P MORGAN, LONDON | USD     | 20/06/2029         | -                                     | Vereinigte Mexikanische Staaten   | US91087BAC46                            | 3.035.000         | (4.765)  |
| J.P MORGAN, LONDON | USD     | 20/06/2029         | (7.020.000)                           | Volksrepublik China               | US712219AG90                            | (7.020.000)       | (12.021)   |
| J.P MORGAN, LONDON | USD     | 20/06/2029         | -                                     | Republik Peru                     | US715638AP79                            | 8.300.000         | (18.596)   |
| J.P MORGAN, LONDON | USD     | 20/06/2029         | -                                     | Republik Panama                   | US698299AD63                            | 2.030.000         | (8.109)  |
|                    |         |                    |                                       |                                   |   | <b>USD</b>        | <b>(1.490.696)</b>   |

### Global High Yield Bond

#### Credit Default Swaps

| Kontrahent         | Währung | Fälligkeits-termin | Kapitalzusage in Teilfondswährung USD | Basistitel          | Zugrunde liegende ISIN/Bloomberg-Ticker | Netto-nenn-betrag | Nicht realisierter Gewinn in der Teilfondswährung |
|--------------------|---------|--------------------|---------------------------------------|---------------------|---|-------------------|---|
| J.P MORGAN, LONDON | USD     | 20/12/2028         | -                                     | CDX.NA.HY Series 41 | 2165BRAB1                               | 3.793.680         | (105.072)   |
|                    |         |                    |                                       |                     |   | <b>USD</b>        | <b>(105.072)</b>                                  |

### Global Inflation Linked Bond

#### Zinsswaps

| Kontrahent         | Währung | Fälligkeits-termin | Payer-Zinssatz          | Receiver-Zinssatz | Kapitalzusage in Währung des Instruments | Netto-nenn-betrag | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|--------------------|---------|--------------------|-------------------------|-------------------|--|-------------------|--|
| J.P MORGAN, LONDON | EUR     | 26/05/2032         | Floating (LIBOR Index)* | 1,683 %           | 3.703.704                                | 4.000.000         | (345.870)  |
| GOLDMAN SACHS      | EUR     | 16/08/2032         | Floating (LIBOR Index)* | 1,825 %           | 1.851.852                                | 2.000.000         | (122.309)  |
|                    |         |                    |                         |                   |  | <b>USD</b>        | <b>(468.179)</b>   |

\* Bei den angegebenen variablen Zinssätzen handelt es sich um die zum Ende des Geschäftsjahres geltenden Werte.

# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## Swaps (Fortsetzung)

### Global Lower Carbon Bond

#### Credit Default Swaps

| Kontrahent         | Währung | Fälligkeits-termin | Kapitalzusage in Teilfondswährung USD | Basistitel          | Zugrunde liegende ISIN/Bloomberg-Ticker | Netto-nenn-betrag | Nicht realisierter Gewinn in Teilfondswährung |
|--------------------|---------|--------------------|---------------------------------------|---------------------|---|-------------------|---|
| BARCLAYS BANK, PLC | USD     | 20/06/2028         | (5.000.000)                           | CDX.NA.IG Series 40 | 2165BYEC5                               | (5.000.000)       | 13.706  |
|                    |         |                    |                                       |                     |   | <b>USD</b>        | <b>13.706</b>                                 |

### Global Short Duration Bond

#### Zinsswaps

| Kontrahent         | Währung | Fälligkeits-termin | Payer-Zinssatz         | Receiver-Zinssatz | Kapitalzusage in Währung des Instruments | Netto-nenn-betrag | Nicht realisierter Verlust in der Währung des Teilfonds |
|--------------------|---------|--------------------|------------------------|-------------------|--|-------------------|---|
| J.P MORGAN, LONDON | USD     | 13/06/2025         | Floating (SOFR Index)* | 4,493 %           | 5.000.000                                | 5.000.000         | (24.641)  |
|                    |         |                    |                        |                   |  | <b>USD</b>        | <b>(24.641)</b>   |

\* Bei den angegebenen variablen Zinssätzen handelt es sich um die zum Ende des Geschäftsjahres geltenden Werte.

### US High Yield Bond

#### Credit Default Swaps

| Kontrahent         | Währung | Fälligkeits-termin | Kapitalzusage in Teilfondswährung USD | Basistitel          | Zugrunde liegende ISIN/Bloomberg-Ticker | Netto-nenn-betrag | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|--------------------|---------|--------------------|---------------------------------------|---------------------|---|-------------------|--|
| J.P MORGAN, LONDON | USD     | 20/12/2028         | -                                     | CDX.NA.HY Series 41 | 2165BRAB1                               | 183.150           | (5.073)  |
|                    |         |                    |                                       |                     |   | <b>USD</b>        | <b>(5.073)</b>   |

### Global Emerging Markets Multi-Asset Income

#### Zinsswaps

| Kontrahent         | Währung | Fälligkeits-termin | Payer-Zinssatz             | Receiver-Zinssatz          | Kapitalzusage in Währung des Instruments | Netto-nenn-betrag | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|--------------------|---------|--------------------|----------------------------|----------------------------|--|-------------------|--|
| J.P MORGAN, LONDON | CZK     | 14/12/2025         | Floating (PRIBOR6M Index)* | 4,603 %                    | 304.369.072                              | 13.000.000        | 3.847  |
| J.P MORGAN, LONDON | PLN     | 06/03/2029         | 4,779 %                    | Floating (WIBOR6M Index)*  | 3.588.962                                | 900.000           | 1.946  |
| BARCLAYS BANK, PLC | CZK     | 16/12/2031         | 2,873 %                    | Floating (PRIBOR6M Index)* | 23.413.051                               | 1.000.000         | 2.364  |
| J.P MORGAN, LONDON | MXN     | 21/12/2033         | 8,520 %                    | Floating (MXIBTIIE Index)* | 44.878.820                               | 2.700.000         | 2.411  |
|                    |         |                    |                            |                            |  | <b>USD</b>        | <b>10.568</b>  |

\* Bei den angegebenen variablen Zinssätzen handelt es sich um die zum Ende des Geschäftsjahres geltenden Werte.

### Global Emerging Markets Multi-Asset Income

#### Credit Default Swaps

| Kontrahent         | Währung | Fälligkeits-termin | Kapitalzusage in Teilfondswährung USD | Basistitel         | Zugrunde liegende ISIN/Bloomberg-Ticker | Netto-nenn-betrag | Nicht realisierter Verlust in der Währung des Teilfonds |
|--------------------|---------|--------------------|---------------------------------------|--------------------|---|-------------------|---|
| J.P MORGAN, LONDON | USD     | 20/06/2029         | -                                     | Republik Kolumbien | US195325BB02                            | 500.000           | (2.038)   |
|                    |         |                    |                                       |                    |   | <b>USD</b>        | <b>(2.038)</b>  |

# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## Swaps (Fortsetzung)

### Multi-Asset Style Factors

#### Zinsswaps

| Kontrahent                       | Währung | Fälligkeits-termin | Payer-Zinssatz             | Receiver-Zinssatz          | Kapitalzusage in Währung des Instruments | Netto-nenn-betrag | Nicht realisierter Verlust in der Währung des Teilfonds |
|----------------------------------|---------|--------------------|----------------------------|----------------------------|--|-------------------|---|
| HSBC, LONDON                     | SEK     | 18/08/2033         | Floating (STIBOR3M Index)* | 3,328 %                    | 1.268.664.143                            | 109.860.000       | 526.371   |
| CITIGROUP GLOBAL MARKETS LIMITED | SEK     | 18/08/2033         | Floating (STIBOR3M Index)* | 3,328 %                    | 1.268.664.167                            | 109.860.000       | 530.043   |
| HSBC, LONDON                     | SEK     | 19/05/2032         | 2,511 %                    | Floating (STIBOR3M Index)* | 5.146.254.207                            | 445.640.000       | 393.290   |
| HSBC, LONDON                     | NOK     | 07/12/2033         | 3,520 %                    | Floating (NIBOR6M Index)*  | 1.585.592.226                            | 135.330.000       | 191.245   |
| HSBC, LONDON                     | NOK     | 15/06/2033         | 3,670 %                    | Floating (NIBOR6M Index)*  | 3.074.172.138                            | 262.380.000       | 104.323   |
|                                  |         |                    |                            |                            |  | <b>USD</b>        | <b>1.745.272</b>  |
| HSBC, LONDON                     | SEK     | 01/09/2032         | 2,850 %                    | Floating (STIBOR3M Index)* | 3.969.974.053                            | 343.780.000       | (435.263)   |
| HSBC, LONDON                     | SEK     | 20/04/2033         | 2,978 %                    | Floating (STIBOR3M Index)* | 2.791.846.436                            | 241.760.000       | (548.022)   |
| HSBC, LONDON                     | NOK     | 23/06/2033         | 3,743 %                    | Floating (NIBOR6M Index)*  | 4.306.160.886                            | 367.530.000       | (39.127)  |
| HSBC, LONDON                     | NOK     | 29/06/2033         | 3,768 %                    | Floating (NIBOR6M Index)*  | 2.052.377.198                            | 175.170.000       | (41.236)  |
| HSBC, LONDON                     | NOK     | 10/07/2033         | 3,944 %                    | Floating (NIBOR6M Index)*  | 1.702.874.416                            | 145.340.000       | (207.349)   |
| HSBC, LONDON                     | SEK     | 13/07/2033         | 3,297 %                    | Floating (STIBOR3M Index)* | 2.581.557.165                            | 223.550.000       | (1.019.707)   |
| CITIGROUP GLOBAL MARKETS LIMITED | SEK     | 18/08/2033         | 3,328 %                    | Floating (STIBOR3M Index)* | 1.268.664.043                            | 109.860.000       | (387.862)   |
| HSBC, LONDON                     | NOK     | 24/08/2033         | 4,216 %                    | Floating (NIBOR6M Index)*  | 3.128.536.493                            | 267.020.000       | (880.377)   |
| HSBC, LONDON                     | NOK     | 03/10/2033         | 4,245 %                    | Floating (NIBOR6M Index)*  | 1.573.641.510                            | 134.310.000       | (472.625)   |
| HSBC, LONDON                     | NOK     | 12/10/2033         | 4,264 %                    | Floating (NIBOR6M Index)*  | 1.592.153.540                            | 135.890.000       | (496.509)   |
| HSBC, LONDON                     | SEK     | 02/11/2033         | 3,375 %                    | Floating (STIBOR3M Index)* | 3.006.523.886                            | 260.350.000       | (1.359.145)   |
| HSBC, LONDON                     | NOK     | 30/11/2033         | 3,733 %                    | Floating (NIBOR6M Index)*  | 1.537.671.921                            | 131.240.000       | (5.114)   |
| GOLDMAN SACHS                    | NOK     | 23/02/2034         | 3,880 %                    | Floating (NIBOR6M Index)*  | 1.482.018.666                            | 126.490.000       | (141.683)   |
| CITIGROUP GLOBAL MARKETS LIMITED | NZD     | 02/04/2034         | 4,375 %                    | Floating (BKBM Index)*     | -  | 15.760.000        | (6.555)   |
|                                  |         |                    |                            |                            |  | <b>USD</b>        | <b>(6.040.574)</b>                                      |

\* Bei den angegebenen variablen Zinssätzen handelt es sich um die zum Ende des Geschäftsjahres geltenden Werte.

### Multi-Asset Style Factors

#### Overnight Index Swap

| Kontrahent              | Währung | Fälligkeits-termin | Payer-Zinssatz          | Receiver-Zinssatz | Kapitalzusage in Währung des Instruments | Netto-nenn-betrag | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|-------------------------|---------|--------------------|-------------------------|-------------------|--|-------------------|--|
| HSBC, LONDON            | CHF     | 08/01/2034         | Floating (SARON Index)* | 1,230 %           | 12.256.726                               | 12.600.000        | 104.765  |
| HSBC, LONDON            | CHF     | 12/01/2034         | Floating (SARON Index)* | 1,290 %           | 13.696.404                               | 14.080.000        | 198.672  |
| SOCIETE GENERALE, PARIS | CHF     | 08/02/2034         | Floating (SARON Index)* | 1,310 %           | 25.291.656                               | 26.000.000        | 414.604  |
|                         |         |                    |                         |                   |  | <b>USD</b>        | <b>718.041</b>   |

\* Bei den angegebenen variablen Zinssätzen handelt es sich um die zum Ende des Geschäftsjahres geltenden Werte.

### Multi-Strategy Target Return

#### Total Return Swap

| Kontrahent              | Währung | Fälligkeits-termin | Kapitalzusage in Teilfondswährung USD | Basistitel           | Zugrunde liegende ISIN/Bloomberg-Ticker | Netto-nenn-betrag | Nicht realisierter Verlust in der Währung des Teilfonds |
|-------------------------|---------|--------------------|---------------------------------------|----------------------|---|-------------------|---|
| SOCIETE GENERALE, PARIS | USD     | 28/02/2025         | 7.553.919                             | BCOM Commodity Index | BCOM Index                              | 6.994.370         | 429.710   |
|                         |         |                    |                                       |                      |   | <b>USD</b>        | <b>429.710</b>  |

# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## Swaps (Fortsetzung)

### Multi-Strategy Target Return

#### Zinsswaps

| Kontrahent   | Währung | Fälligkeits-termin | Payer-Zinssatz | Receiver-Zinssatz          | Kapitalzusage in Währung des Instruments | Netto-nenn-betrag | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|--------------|---------|--------------------|----------------|----------------------------|--|-------------------|--|
| HSBC, LONDON | SEK     | 07/10/2031         | 0,895 %        | Floating (STIBOR3M Index)* | 526.473.680                              | 45.590.000        | 467.987  |
|              |         |                    |                |                            |  | <b>USD</b>        | <b>467.987</b>   |
| HSBC, LONDON | SEK     | 02/06/2033         | 2,907 %        | Floating (STIBOR3M Index)* | 280.962.924                              | 24.330.000        | (43.567)   |
| HSBC, LONDON | NOK     | 10/07/2033         | 3,971 %        | Floating (NIBOR6M Index)*  | 229.877.511                              | 19.620.000        | (31.529)   |
| HSBC, LONDON | NOK     | 27/07/2033         | 3,944 %        | Floating (NIBOR6M Index)*  | 318.454.132                              | 27.180.000        | (39.616)   |
| HSBC, LONDON | NOK     | 24/08/2033         | 4,217 %        | Floating (NIBOR6M Index)*  | 259.754.566                              | 22.170.000        | (73.245)   |
| HSBC, LONDON | SEK     | 24/08/2033         | 3,430 %        | Floating (STIBOR3M Index)* | 392.055.042                              | 33.950.000        | (188.279)  |
|              |         |                    |                |                            |  | <b>USD</b>        | <b>(376.236)</b>   |

\* Bei den angegebenen variablen Zinssätzen handelt es sich um die zum Ende des Geschäftsjahres geltenden Werte.

### Multi-Strategy Target Return

#### Overnight Index Swap

| Kontrahent   | Währung | Fälligkeits-termin | Payer-Zinssatz | Receiver-Zinssatz       | Kapitalzusage in Währung des Instruments | Netto-nenn-betrag | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Währung des Teilfonds |
|--------------|---------|--------------------|----------------|-------------------------|--|-------------------|--|
| HSBC, LONDON | CHF     | 03/07/2033         | 1,723 %        | Floating (SARON Index)* | 4.299.582                                | 4.420.000         | 239.890  |
|              |         |                    |                |                         |  | <b>USD</b>        | <b>239.890</b>   |

\* Bei den angegebenen variablen Zinssätzen handelt es sich um die zum Ende des Geschäftsjahres geltenden Werte.

# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## Optionen

Am 31. März 2024 hat die Gesellschaft die folgenden OTC-Optionskontrakte abgeschlossen:

| Teilfonds                                     | Makler                                    | Gekaufte/<br>(geschriebene)<br>Menge | Strike<br>(in<br>Handelswährung) | Handelswährung | Fälligkeits-<br>termin | Basistitel | Engagement -<br>(in<br>Handelswährung) | Marktwert in<br>Währung<br>des<br>Teilfonds |
|---|---|--------------------------------------|----------------------------------|----------------|------------------------|------------|--|---|
| <b>Global Emerging Debt Total Return</b>      |   |                                      |                                  |                |                        |            |  |   |
| PUT FX OPTIONS                                | Merrill Lynch International               | (2.000.000)                          | 846                              | USD            | 02/04/2024             | FX OPTIONS | 1.691.440.000                          | 20.432                                      |
| PUT FX OPTIONS                                | UBS AG                                    | (2.000.000)                          | 81                               | USD            | 19/04/2024             | FX OPTIONS | 161.580.400                            | 2.831                                       |
| CALL FX OPTIONS                               | UBS AG                                    | (1.700.000)                          | 377                              | USD            | 24/04/2024             | FX OPTIONS | 641.274.000                            | 9.880                                       |
| PUT FX OPTIONS                                | UBS AG                                    | (1.700.000)                          | 342                              | USD            | 24/04/2024             | FX OPTIONS | 581.332.000                            | 8.753                                       |
| CALL FX OPTIONS                               | UBS AG                                    | (1.600.000)                          | 20                               | USD            | 14/05/2024             | FX OPTIONS | 32.709.920                             | 9.579                                       |
| PUT FX OPTIONS                                | UBS AG                                    | (1.600.000)                          | 18                               | USD            | 14/05/2024             | FX OPTIONS | 29.147.040                             | 2.800                                       |
| CALL FX OPTIONS                               | BNP Paribas Securities<br>Services        | (800.000)                            | 19                               | USD            | 06/06/2024             | FX OPTIONS | 14.819.680                             | 1.647                                       |
| PUT FX OPTIONS                                | Merrill Lynch International               | (1.600.000)                          | 5                                | USD            | 04/09/2024             | FX OPTIONS | 7.362.880                              | 2.360                                       |
|   |   |                                      |                                  |                |                        |            | <b>USD</b>                             | <b>58.282</b>                               |
| CALL FX OPTIONS                               | Merrill Lynch International               | (2.000.000)                          | 959                              | USD            | 02/04/2024             | FX OPTIONS | 1.918.240.000                          | (29.710)                                    |
| PUT FX OPTIONS                                | Merrill Lynch International               | 2.000.000                            | 872                              | USD            | 02/04/2024             | FX OPTIONS | -                                      | (41.252)                                    |
| PUT FX OPTIONS                                | UBS AG                                    | 2.000.000                            | 83                               | USD            | 19/04/2024             | FX OPTIONS | -                                      | (11.301)                                    |
| PUT FX OPTIONS                                | UBS AG                                    | 1.700.000                            | 350                              | USD            | 24/04/2024             | FX OPTIONS | -                                      | (19.669)                                    |
| PUT FX OPTIONS                                | UBS AG                                    | 1.600.000                            | 19                               | USD            | 14/05/2024             | FX OPTIONS | -                                      | (1.793)                                     |
| CALL FX OPTIONS                               | BNP Paribas Securities<br>Services        | 800.000                              | 18                               | USD            | 06/06/2024             | FX OPTIONS | -                                      | (5.037)                                     |
| PUT FX OPTIONS                                | Merrill Lynch International               | 1.600.000                            | 5                                | USD            | 04/09/2024             | FX OPTIONS | -                                      | (6.945)                                     |
|   |   |                                      |                                  |                |                        |            | <b>USD</b>                             | <b>(115.707)</b>                            |
| <b>Global Emerging Markets ESG Local Debt</b> |   |                                      |                                  |                |                        |            |  |   |
| PUT FX OPTIONS                                | Merrill Lynch International               | (6.000.000)                          | 842                              | USD            | 02/04/2024             | FX OPTIONS | 5.051.580.000                          | 61.866                                      |
| CALL FX OPTIONS                               | Morgan Stanley & Co.<br>International Plc | (3.800.000)                          | 5                                | USD            | 15/04/2024             | FX OPTIONS | 19.717.440                             | 25.076                                      |
| PUT FX OPTIONS                                | Morgan Stanley & Co.<br>International Plc | (3.800.000)                          | 5                                | USD            | 15/04/2024             | FX OPTIONS | 17.585.260                             | 15.793                                      |
| CALL FX OPTIONS                               | UBS AG                                    | (5.500.000)                          | 377                              | USD            | 24/04/2024             | FX OPTIONS | 2.074.710.000                          | 31.965                                      |
| PUT FX OPTIONS                                | UBS AG                                    | (5.500.000)                          | 342                              | USD            | 24/04/2024             | FX OPTIONS | 1.880.780.000                          | 28.319                                      |
| CALL FX OPTIONS                               | UBS AG                                    | (5.800.000)                          | 20                               | USD            | 14/05/2024             | FX OPTIONS | 118.573.460                            | 34.724                                      |
| PUT FX OPTIONS                                | UBS AG                                    | (5.800.000)                          | 18                               | USD            | 14/05/2024             | FX OPTIONS | 105.658.020                            | 10.149                                      |
| CALL FX OPTIONS                               | BNP Paribas Securities<br>Services        | (2.900.000)                          | 19                               | USD            | 06/06/2024             | FX OPTIONS | 53.721.340                             | 5.970                                       |
| CALL FX OPTIONS                               | Morgan Stanley & Co.<br>International Plc | (5.800.000)                          | 5                                | USD            | 17/06/2024             | FX OPTIONS | 31.019.560                             | 5.989                                       |
| PUT FX OPTIONS                                | Morgan Stanley & Co.<br>International Plc | (5.800.000)                          | 5                                | USD            | 17/06/2024             | FX OPTIONS | 27.822.600                             | 587   |
| PUT FX OPTIONS                                | Merrill Lynch International               | (6.300.000)                          | 5                                | USD            | 04/09/2024             | FX OPTIONS | 28.991.340                             | 9.295                                       |
| PUT FX OPTIONS                                | UBS AG                                    | (6.400.000)                          | 81                               | USD            | 17/09/2024             | FX OPTIONS | 517.797.120                            | 1.338                                       |
|   |   |                                      |                                  |                |                        |            | <b>USD</b>                             | <b>231.071</b>                              |
| CALL FX OPTIONS                               | Merrill Lynch International               | (6.000.000)                          | 954                              | USD            | 02/04/2024             | FX OPTIONS | 5.723.700.000                          | (111.967)                                   |
| PUT FX OPTIONS                                | Merrill Lynch International               | 6.000.000                            | 867                              | USD            | 02/04/2024             | FX OPTIONS | -                                      | (124.806)                                   |
| PUT FX OPTIONS                                | Morgan Stanley & Co.<br>International Plc | 3.800.000                            | 5                                | USD            | 15/04/2024             | FX OPTIONS | -                                      | (50.308)                                    |
| PUT FX OPTIONS                                | UBS AG                                    | 5.500.000                            | 350                              | USD            | 24/04/2024             | FX OPTIONS | -                                      | (63.635)                                    |
| PUT FX OPTIONS                                | UBS AG                                    | 5.800.000                            | 19                               | USD            | 14/05/2024             | FX OPTIONS | -                                      | (6.498)                                     |
| CALL FX OPTIONS                               | BNP Paribas Securities<br>Services        | 2.900.000                            | 18                               | USD            | 06/06/2024             | FX OPTIONS | -                                      | (18.261)                                    |
| PUT FX OPTIONS                                | Morgan Stanley & Co.<br>International Plc | 5.800.000                            | 5                                | USD            | 17/06/2024             | FX OPTIONS | -                                      | (1.198)                                     |

# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## Optionen (Fortsetzung)

Am 31. März 2024 hat die Gesellschaft die folgenden OTC-Optionskontrakte abgeschlossen (Fortsetzung):

| Teilfonds   | Makler                                    | Gekaufte/<br>(geschriebene)<br>Menge | Strike<br>(in<br>Handelswährung) | Handelswährung | Fälligkeits-<br>termin | Basistitel | Engagement -<br>(in<br>Handelswährung) | Marktwert in<br>Währung<br>des<br>Teilfonds |
|---|---|--------------------------------------|----------------------------------|----------------|------------------------|------------|--|---|
| <b>Global Emerging Markets ESG Local Debt (Fortsetzung)</b> |   |                                      |                                  |                |                        |            |  |   |
| PUT FX OPTIONS  | Merrill Lynch International               | 6.300.000                            | 5                                | USD            | 04/09/2024             | FX OPTIONS | -                                      | (27.347)                                    |
| PUT FX OPTIONS  | UBS AG                                    | 6.400.000                            | 83                               | USD            | 17/09/2024             | FX OPTIONS | -                                      | (9.528)                                     |
|   |   |                                      |                                  |                |                        |            | <b>USD</b>                             | <b>(413.548)</b>                            |
| <b>Global Emerging Markets Local Debt</b>                   |   |                                      |                                  |                |                        |            |  |   |
| PUT FX OPTIONS  | Merrill Lynch International               | (18.100.000)                         | 842                              | USD            | 02/04/2024             | FX OPTIONS | 15.238.933.000                         | 186.629                                     |
| CALL FX OPTIONS   | Morgan Stanley & Co.<br>International Pic | (11.300.000)                         | 5                                | USD            | 15/04/2024             | FX OPTIONS | 58.633.440                             | 74.570                                      |
| PUT FX OPTIONS  | Morgan Stanley & Co.<br>International Pic | (11.300.000)                         | 5                                | USD            | 15/04/2024             | FX OPTIONS | 52.293.010                             | 46.964                                      |
| CALL FX OPTIONS   | UBS AG                                    | (17.400.000)                         | 377                              | USD            | 24/04/2024             | FX OPTIONS | 6.563.628.000                          | 101.125                                     |
| PUT FX OPTIONS  | UBS AG                                    | (17.400.000)                         | 342                              | USD            | 24/04/2024             | FX OPTIONS | 5.950.104.000                          | 89.590                                      |
| CALL FX OPTIONS   | UBS AG                                    | (18.100.000)                         | 20                               | USD            | 14/05/2024             | FX OPTIONS | 370.030.970                            | 108.364                                     |
| PUT FX OPTIONS  | UBS AG                                    | (18.100.000)                         | 18                               | USD            | 14/05/2024             | FX OPTIONS | 329.725.890                            | 31.672                                      |
| CALL FX OPTIONS   | BNP Paribas Securities Services           | (10.000.000)                         | 19                               | USD            | 06/06/2024             | FX OPTIONS | 185.246.000                            | 20.587                                      |
| CALL FX OPTIONS   | Morgan Stanley & Co.<br>International Pic | (18.700.000)                         | 5                                | USD            | 17/06/2024             | FX OPTIONS | 100.011.340                            | 19.308                                      |
| PUT FX OPTIONS  | Morgan Stanley & Co.<br>International Pic | (18.700.000)                         | 5                                | USD            | 17/06/2024             | FX OPTIONS | 89.703.900                             | 1.893                                       |
| PUT FX OPTIONS  | Merrill Lynch International               | (19.500.000)                         | 5                                | USD            | 04/09/2024             | FX OPTIONS | 89.735.100                             | 28.769                                      |
| PUT FX OPTIONS  | UBS AG                                    | (21.000.000)                         | 81                               | USD            | 17/09/2024             | FX OPTIONS | 1.699.021.800                          | 4.391                                       |
|   |   |                                      |                                  |                |                        |            | <b>USD</b>                             | <b>713.862</b>                              |
| PUT FX OPTIONS  | Merrill Lynch International               | 18.100.000                           | 867                              | USD            | 02/04/2024             | FX OPTIONS | -                                      | (376.498)                                   |
| CALL FX OPTIONS   | Merrill Lynch International               | (18.100.000)                         | 954                              | USD            | 02/04/2024             | FX OPTIONS | 17.266.495.000                         | (337.767)                                   |
| PUT FX OPTIONS  | Morgan Stanley & Co.<br>International Pic | 11.300.000                           | 5                                | USD            | 15/04/2024             | FX OPTIONS | -                                      | (149.601)                                   |
| PUT FX OPTIONS  | UBS AG                                    | 17.400.000                           | 350                              | USD            | 24/04/2024             | FX OPTIONS | -                                      | (201.318)                                   |
| PUT FX OPTIONS  | UBS AG                                    | 18.100.000                           | 19                               | USD            | 14/05/2024             | FX OPTIONS | -                                      | (20.278)                                    |
| CALL FX OPTIONS   | BNP Paribas Securities Services           | 10.000.000                           | 18                               | USD            | 06/06/2024             | FX OPTIONS | -                                      | (62.967)                                    |
| PUT FX OPTIONS  | Morgan Stanley & Co.<br>International Pic | 18.700.000                           | 5                                | USD            | 17/06/2024             | FX OPTIONS | -                                      | (3.862)                                     |
| PUT FX OPTIONS  | Merrill Lynch International               | 19.500.000                           | 5                                | USD            | 04/09/2024             | FX OPTIONS | -                                      | (84.645)                                    |
| PUT FX OPTIONS  | UBS AG                                    | 21.000.000                           | 83                               | USD            | 17/09/2024             | FX OPTIONS | -                                      | (31.265)                                    |
|   |   |                                      |                                  |                |                        |            | <b>USD</b>                             | <b>(1.268.201)</b>                          |
| <b>Global Emerging Markets Multi-Asset Income</b>           |   |                                      |                                  |                |                        |            |  |   |
| PUT FX OPTIONS  | Merrill Lynch International               | (400.000)                            | 842                              | USD            | 02/04/2024             | FX OPTIONS | 336.772.000                            | 4.124                                       |
| CALL FX OPTIONS   | Morgan Stanley & Co.<br>International Pic | (300.000)                            | 5                                | USD            | 15/04/2024             | FX OPTIONS | 1.556.640                              | 1.980                                       |
| PUT FX OPTIONS  | Morgan Stanley & Co.<br>International Pic | (300.000)                            | 5                                | USD            | 15/04/2024             | FX OPTIONS | 1.388.310                              | 1.247                                       |
| CALL FX OPTIONS   | UBS AG                                    | (400.000)                            | 377                              | USD            | 24/04/2024             | FX OPTIONS | 150.888.000                            | 2.325                                       |
| PUT FX OPTIONS  | UBS AG                                    | (400.000)                            | 342                              | USD            | 24/04/2024             | FX OPTIONS | 136.784.000                            | 2.059                                       |
| CALL FX OPTIONS   | UBS AG                                    | (400.000)                            | 20                               | USD            | 14/05/2024             | FX OPTIONS | 8.177.480                              | 2.395                                       |
| PUT FX OPTIONS  | UBS AG                                    | (400.000)                            | 18                               | USD            | 14/05/2024             | FX OPTIONS | 7.286.760                              | 700   |
| CALL FX OPTIONS   | BNP Paribas Securities Services           | (200.000)                            | 19                               | USD            | 06/06/2024             | FX OPTIONS | 3.704.920                              | 412   |
| CALL FX OPTIONS   | Morgan Stanley & Co.<br>International Pic | (400.000)                            | 5                                | USD            | 17/06/2024             | FX OPTIONS | 2.139.280                              | 413   |
| PUT FX OPTIONS  | Morgan Stanley & Co.<br>International Pic | (400.000)                            | 5                                | USD            | 17/06/2024             | FX OPTIONS | 1.918.800                              | 40  |

# Aufstellung der Derivate

zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## Optionen (Fortsetzung)

Am 31. März 2024 hat die Gesellschaft die folgenden OTC-Optionskontrakte abgeschlossen (Fortsetzung):

| Teilfonds   | Makler                                    | Gekaufte/<br>(geschriebene)<br>Menge | Strike<br>(in<br>Handelswährung) | Handelswährung | Fälligkeits-<br>termin | Basistitel | Engagement -<br>(in<br>Handelswährung) | Marktwert in<br>Währung des<br>Teilfonds |
|---|---|--------------------------------------|----------------------------------|----------------|------------------------|------------|--|--|
| <b>Global Emerging Markets Multi-Asset Income (Fortsetzung)</b> |   |                                      |                                  |                |                        |            |  |  |
| PUT FX OPTIONS  | Merrill Lynch International               | (400.000)                            | 5                                | USD            | 04/09/2024             | FX OPTIONS | 1.840.720                              | 590                                      |
| PUT FX OPTIONS  | UBS AG                                    | (400.000)                            | 81                               | USD            | 17/09/2024             | FX OPTIONS | 32.362.320                             | 84                                       |
|   |   |                                      |                                  |                |                        |            | <b>USD</b>                             | <b>16.369</b>                            |
| CALL FX OPTIONS   | Merrill Lynch International               | (400.000)                            | 954                              | USD            | 02/04/2024             | FX OPTIONS | 381.580.000                            | (7.464)                                  |
| PUT FX OPTIONS  | Merrill Lynch International               | 400.000                              | 867                              | USD            | 02/04/2024             | FX OPTIONS | -                                      | (8.320)                                  |
| PUT FX OPTIONS  | Morgan Stanley & Co.<br>International Plc | 300.000                              | 5                                | USD            | 15/04/2024             | FX OPTIONS | -                                      | (3.972)                                  |
| PUT FX OPTIONS  | UBS AG                                    | 400.000                              | 350                              | USD            | 24/04/2024             | FX OPTIONS | -                                      | (4.628)                                  |
| PUT FX OPTIONS  | UBS AG                                    | 400.000                              | 19                               | USD            | 14/05/2024             | FX OPTIONS | -                                      | (448)                                    |
| CALL FX OPTIONS   | BNP Paribas Securities<br>Services        | 200.000                              | 18                               | USD            | 06/06/2024             | FX OPTIONS | -                                      | (1.259)                                  |
| PUT FX OPTIONS  | Morgan Stanley & Co.<br>International Plc | 400.000                              | 5                                | USD            | 17/06/2024             | FX OPTIONS | -                                      | (83)                                     |
| PUT FX OPTIONS  | Merrill Lynch International               | 400.000                              | 5                                | USD            | 04/09/2024             | FX OPTIONS | -                                      | (1.736)                                  |
| PUT FX OPTIONS  | UBS AG                                    | 400.000                              | 83                               | USD            | 17/09/2024             | FX OPTIONS | -                                      | (596)                                    |
|   |   |                                      |                                  |                |                        |            | <b>USD</b>                             | <b>(28.506)</b>                          |

Zum 31. März 2024 hat die Gesellschaft die folgenden an einem geregelten Markt gehandelten Optionen abgeschlossen:

| Teilfonds                           | Makler        | Gekaufte/<br>(geschriebene)<br>Menge | Strike<br>(in<br>Handelswährung) | Handelswährung | Fälligkeits-<br>termin | Basistitel                     | Engagement -<br>(in<br>Handelswährung) | Marktwert in<br>Währung des<br>Teilfonds |
|-------------------------------------|---------------|--------------------------------------|----------------------------------|----------------|------------------------|--------------------------------|--|--|
| <b>Multi-Strategy Target Return</b> |               |                                      |                                  |                |                        |                                |  |  |
| PUT OPTION EQUITY<br>INDEX          | HSBC Bank Plc | 200                                  | 100                              | EUR            | 21/06/2024             | EURO STOXX Banks               | -                                      | 2.000                                    |
| CALL FUTURE BOND<br>OPTIONS         | HSBC Bank Plc | 150                                  | 6.100                            | HKD            | 19/04/2024             | HANG SENG CHINA<br>ENTERPRISES | -                                      | 37.267                                   |
| PUT OPTION EQUITY<br>INDEX          | HSBC Bank Plc | 135                                  | 4.750                            | EUR            | 19/04/2024             | EURO STOXX 50                  | -                                      | 7.020                                    |
|                                     |               |                                      |                                  |                |                        |                                | <b>EUR</b>                             | <b>46.287</b>                            |

# Erläuterungen zum Abschluss

für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024

## 1. Grundlage der Darstellung Erläuterungen zum Abschluss

HSBC Global Investment Funds (die „Gesellschaft“) wurde als eine Investmentgesellschaft mit variablem Kapital (Société d'Investissement à Capital Variable, kurz „SICAV“ genannt) nach dem Recht des Großherzogtums Luxemburg gegründet. Das Gesellschaftskapital besteht aus verschiedenen Portfolios (ein „Teilfonds“), die sich aus Wertpapieren, liquiden Mitteln und sonstigen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten zusammensetzen, und jeder Teilfonds kann verschiedene Anteilsklassen enthalten, die sich von den anderen aufgrund ihrer Gebührenstruktur, Ausschüttungspolitik und Ziellanleger unterscheiden.

Der beigefügte Abschluss enthält eine Aufstellung aller Vermögenswerte und Verbindlichkeiten sowie die Ertrags- und Aufwandsrechnung und die Veränderungen des Nettovermögens jedes einzelnen Teilfonds und der gesamten Gesellschaft. Die Abschlüsse der einzelnen Teilfonds sind in der Währung ausgedrückt, die im Prospekt des jeweiligen Teilfonds angegeben ist. Die Konsolidierungswährung der Gesellschaft ist der US-Dollar (USD). Die konsolidierte Aufstellung des Nettovermögens und die konsolidierte Aufwands- und Ertragsrechnung sowie Aufstellung über die Veränderung des Nettovermögens ergeben die Summe des Abschlusses für jeden Teilfonds.

Der Abschluss wurde in der von den luxemburgischen Behörden für luxemburgische Investmentgesellschaften vorgeschriebenen Form nach dem Grundsatz der Unternehmensfortführung erstellt, ausgenommen für die Teilfonds Global Credit Floating Rate Fixed Term Bond 2023 -1, Mexico Equity, Global Credit Floating Rate Fixed Term Bond 2023 - 2 und Brazil Bond. Die vier Teilfonds wurden am 5. Juli 2023, am 28. Juli 2023, am 29. Dezember 2023 und am 15. Mai 2024 aufgelöst, so dass die Jahresabschlüsse für diese Teilfonds auf der Basis der Nichtfortführung erstellt wurden.

Bei den Teilfonds, für die der Abschluss nach dem Grundsatz der Unternehmensfortführung erstellt wurde, weichen die folgenden Rechnungslegungsgrundsätze von den in den nachstehenden Erläuterungen beschriebenen Grundsätzen ab:

- Erwartete Liquidationskosten werden gegebenenfalls im Rahmen der Betriebs-, Verwaltungs- und Dienstleistungsgebühren gedeckt;

- Alle verbleibenden Gründungskosten wurden vollständig als Aufwand erfasst;

- Die Bewertung der Anlagen der Teilfonds basiert auf ihrem Nettoveräußerungswert.

Die Nichtanwendung des Grundsatzes der Unternehmensfortführung bei der Rechnungslegung hat nicht zu Anpassungen des veröffentlichten Nettoinventarwerts der Teilfonds geführt.

Die Gesellschaft ist ein gemäß den Bestimmungen von Teil I des aktualisierten Gesetzes von 2010 ordnungsgemäß eingetragener Investmentfonds und ist gemäß der Europäischen Richtlinie 2009/65/EG als OGAW qualifiziert.

Einige Teilfonds der Gesellschaft sind durch die Hong Kong Securities and Futures Commission gemäß Abschnitt 104 der „Securities and Futures Ordinance“ zugelassen.

Im Prospekt und in den verschiedenen Berichten werden die Kurznamen der Teilfonds verwendet. Der vollständige Name jedes Teilfonds setzt sich aus „HSBC Global Investment Funds“ und dem Kurznamen jedes Teilfonds zusammen.

Vom 1. April 2023 bis zum 31. März 2024:

a) Folgende Teilfonds wurden geschlossen:

- ▶ Global Credit Floating Rate Fixed Term Bond 2023 – 1 am 5. Juli 2023
- ▶ Mexico Equity am 28. Juli 2023
- ▶ Global Credit Floating Rate Fixed Term Bond 2023 – 2 am 29. Dezember 2023

b) Der folgende Teilfonds wurde aufgelegt:

- ▶ Corporate Euro Bond Fixed Term 2027 am 30. Juni 2023

c) Folgende Teilfonds wurden umbenannt:

- ▶ Der Global Short Duration High Yield Bond wurde mit Wirkung zum 3. Juli 2023 in US Short Duration High Yield Bond umbenannt.
- ▶ Thai Equity wurde zum 1. August 2023 in ASEAN Equity umbenannt.

## 2. Rechnungslegungs- und Bilanzierungsgrundsätze

Auf alle mit dem Abschluss der Gesellschaft in Verbindung stehenden Vermögensgegenstände wurden durchgehend die folgenden Rechnungslegungs- und Bilanzierungsgrundsätze angewandt:

### a) Rechnungslegungskonvention

Der Jahresabschluss wird gemäß den gesetzlichen Bestimmungen und Anforderungen des Großherzogtums Luxemburg in Bezug auf Investmentfonds erstellt.



# Erläuterungen zum Abschluss

## für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

### 2. Rechnungslegungsgrundsätze (Fortsetzung)

#### b) Bewertung der Vermögenswerte und Anlagepapiere

Anlagepapiere bzw. Finanzderivate, die an einer amtlichen Börse notiert sind, werden mit dem zuletzt verfügbaren Kurs am wichtigsten Markt angesetzt, an dem diese Wertpapiere gehandelt werden. Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden, werden mit dem zum Zeitpunkt der Bewertung zuletzt verfügbaren Kurs oder Rendite-Äquivalent angesetzt, die von einem oder mehreren Händlern an solchen geregelten Märkten bereitgestellt werden.

Wenn die Kurse nicht den angemessenen Wert repräsentieren, werden die Wertpapiere und alle anderen zulässigen Vermögenswerte zum Zeitwert bewertet, zu dem sie voraussichtlich wieder verkauft werden können. Dieser Zeitwert wird nach Treu und Glauben vom Verwaltungsrat oder nach dessen Anweisungen ermittelt.

Die Vermögenswerte der Teilfonds werden mit den Kursen bewertet, die zu verschiedenen Zeiten am 31. März 2024 zur Verfügung standen, bei dem es sich um den letzten Geschäftstag des Berichtszeitraums handelte.

Finanzderivate, die nicht an einer amtlichen Börse notiert sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden, werden gemäß den Marktgepflogenheiten wie folgt bewertet:

#### *Optionen*

An einem geregelten Markt gehandelte ausstehende Optionen werden zum Intraday-Kurs oder zum letzten verfügbaren Marktkurs der Instrumente bewertet.

OTC-Optionen werden nach der Mark-to-Market-Methode auf Grundlage der täglichen Preise bewertet, die von externen Preisanbietern bereitgestellt und mit dem Wert des Kontrahenten verglichen werden.

Der Marktwert von Optionen ist in der Aufstellung des Nettovermögens unter der Überschrift „Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) aus Optionen“ ausgewiesen.

Realisierte Gewinne/(Verluste) und Veränderungen des nicht realisierten Wertzuwachses/(Wertverlusts) aus Optionen sind jeweils in der Aufwands- und Ertragsrechnung und den Veränderungen des Nettovermögens unter „Realisierter Gewinn/(Verlust) aus Derivaten“ und „Veränderung des nicht realisierten Bewertungsergebnisses aus Derivaten“ ausgewiesen.

#### *Futures-Kontrakte*

Bei Abschluss eines Futures-Kontrakts muss die Gesellschaft beim Makler einen Barbetrag und/oder sonstige Vermögenswerte hinterlegen, die einem bestimmten Prozentsatz des Kontraktbetrags entsprechen. Dies wird als Einschusskonto bezeichnet. Die als Nachschuss bezeichneten Folgezahlungen werden von den einzelnen Teilfonds regelmäßig geleistet bzw. entgegengenommen und basieren auf den Wertschwankungen der ausstehenden Futures-Kontrakte.

Der nicht realisierte Wertzuwachs/(Wertverlust) aus Futures-Kontrakten ist jeweils in der Aufstellung des Nettovermögens unter „Nicht realisierter Gewinn aus Futures“ und „Nicht realisierter Verlust aus Futures“ aufgeführt. Die Wertschwankungen der ausstehenden Futures-Kontrakte sind als nicht realisierter Wertzuwachs/(Wertverlust) in der Aufwands- und Ertragsrechnung und den Veränderungen des Nettovermögens unter „Veränderung des nicht realisierten Bewertungsergebnisses aus Derivaten“ aufgeführt. Realisierte Gewinne oder Verluste, die der Differenz zwischen dem Wert des Kontrakts zur Zeit des Abschlusses und dem Wert zum Zeitpunkt der Glattstellung entsprechen, werden bei Beendigung oder Ablauf des betreffenden Futures-Kontrakts in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und den Änderungen des Nettovermögens unter „Realisierter Gewinn/(Verlust) aus Derivaten“ aufgeführt. In einem Einschusskonto hinterlegte Wertpapiere sind in der Aufstellung der Wertpapierbestände und des sonstigen Nettovermögens ausgewiesen. Bareinlagen sind in der Aufstellung des Nettovermögens unter „Bankguthaben“ ausgewiesen. Forderungen und/oder Verbindlichkeiten gegenüber Maklern für die täglichen Nachschüsse sind unter der Überschrift „Bankguthaben“ und „Überziehungskredit“ ebenfalls in der Aufstellung des Nettovermögens aufgeführt.

#### *Devisenterminkontrakte*

Der Wert der Devisenterminkontrakte wird für den verbleibenden Zeitraum bis zur Fälligkeit täglich anhand des geltenden Devisenterminkurses der zugrunde liegenden Währung angepasst. Wertänderungen dieser Kontrakte werden bis zum Abwicklungstag des betreffenden Kontrakts als nicht realisierter Wertzuwachs oder Wertverlust ausgewiesen. Bei Glattstellung eines Termingeschäfts verbucht der Teilfonds einen realisierten Gewinn oder Verlust, welcher der Differenz zwischen dem Wert des Kontrakts zum Zeitpunkt des Abschlusses und dem Wert zum Zeitpunkt der Glattstellung entspricht.

# Erläuterungen zum Abschluss

## für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

### 2. Rechnungslegungsgrundsätze (Fortsetzung)

#### b) Bewertung von Vermögenswerten und Wertpapieren (Fortsetzung)

##### *Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)*

Der nicht realisierte Wertzuwachs/(Wertverlust) aus Devisenterminkontrakten ist jeweils in der Aufstellung des Nettovermögens unter „Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten“ und „Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten“ aufgeführt. Die daraus resultierenden realisierten Gewinne/(Verluste) und Veränderungen des nicht realisierten Wertzuwachses/(Wertverlusts) sind jeweils in der Aufwands- und Ertragsrechnung und den Veränderungen des Nettovermögens unter „Realisierter Gewinn/(Verlust) aus Derivaten“ und „Veränderung des nicht realisierten Bewertungsergebnisses aus Derivaten“ aufgeführt.

##### *Zinsswaps*

Zinsswaps werden an jedem NIW-Berechnungstag zum aktuellen Marktkurs bewertet. Der Marktwert basiert auf den in den Kontrakten festgelegten Bewertungselementen und wird von externen Preisanbietern, Market Makern oder internen Modellen bereitgestellt.

Der nicht realisierte Wertzuwachs/(Wertverlust) ist jeweils in der Aufstellung des Nettovermögens unter „Nicht realisierter Gewinn aus Swaps“ und „Nicht realisierter Verlust aus Swaps“ aufgeführt. Die daraus resultierenden realisierten Gewinne/(Verluste) und Veränderungen des nicht realisierten Wertzuwachses/(Wertverlusts) sind jeweils in der Aufwands- und Ertragsrechnung und den Veränderungen des Nettovermögens unter „Realisierter Gewinn/(Verlust) aus Derivaten“ und „Veränderung des nicht realisierten Bewertungsergebnisses aus Derivaten“ aufgeführt.

##### *Credit Default Swaps*

Ein Credit Default Swap ist ein Kreditderivatgeschäft, in dessen Rahmen zwei Parteien einen Vertrag schließen, wobei die eine Vertragspartei (der Sicherungsnehmer) der anderen (dem Sicherungsgeber) über die festgelegte Lebensdauer der Vereinbarung einen regelmäßigen Kupon im Gegenzug für eine Zahlung entrichtet, die von einem Kreditereignis im Zusammenhang mit der zugrunde liegenden Referenzverbindlichkeit abhängig ist.

Falls ein Kreditereignis eintritt, muss der Sicherungsgeber eine Zahlung leisten, bei der es sich um Folgendes handeln kann: (i) eine Netto-Barzahlung, die dem fiktiven Betrag des Swaps abzüglich des Auktionswerts der Referenzverbindlichkeit entspricht, oder (ii) der fiktive Betrag des Swaps im Austausch gegen die Auslieferung der Referenzverbindlichkeit. Der Verkauf von Schutz erhöht effektiv die Hebelung des Portfolios einer Gesellschaft bis zum fiktiven Betrag von Swapvereinbarungen.

Credit Default Swaps werden an jedem NIW-Berechnungstag zum aktuellen Marktkurs bewertet. Der Marktwert basiert auf den in den Kontrakten festgelegten Bewertungselementen und wird von externen Preisanbietern, Market Makern oder internen Modellen bereitgestellt.

Der nicht realisierte Wertzuwachs/(Wertverlust) ist jeweils in der Aufstellung des Nettovermögens unter „Nicht realisierter Gewinn aus Swaps“ und „Nicht realisierter Verlust aus Swaps“ aufgeführt. Die daraus resultierenden realisierten Gewinne/(Verluste) und Veränderungen des nicht realisierten Wertzuwachses/(Wertverlusts) sind jeweils in der Aufwands- und Ertragsrechnung und den Veränderungen des Nettovermögens unter „Realisierter Gewinn/(Verlust) aus Derivaten“ und „Veränderung des nicht realisierten Bewertungsergebnisses aus Derivaten“ aufgeführt.

##### *Total Return Swaps*

Ein Total Return Swap ist eine bilaterale Vereinbarung, in der sich die Parteien verpflichten, untereinander Zahlungen basierend auf der Wertentwicklung eines Basiswertes, zum Beispiel eines Wertpapiers, eines Rohstoffs, eines Wertpapierkorbs oder eines Index gegen eine feste oder variable Verzinsung auszutauschen. Eine Partei zahlt die Gesamrendite („Total Return“) eines bestimmten Referenzvermögenswertes und erhält im Gegenzug regelmäßige Zahlungen. Die Gesamtpomformance umfasst dabei Gewinne und Verluste des Basiswertes sowie Zinsen oder Dividenden innerhalb der Vertragsdauer je nach Art des Basiswertes. Die gegenseitigen Zahlungen werden mit Bezugnahme auf einen bestimmten Nominalwert oder eine bestimmte Menge berechnet. In dem Maße, in dem die Gesamrendite des dem Geschäft zugrunde liegenden Basiswertes die Ausgleichszahlung übersteigt oder unterschreitet, erhält die Gesellschaft eine Zahlung vom Kontrahenten oder leistet eine Zahlung an ihn.

Total Return Swaps werden an jedem NIW-Bewertungstag zum Marktwert bewertet. Der geschätzte Marktwert basiert auf den im Vertrag festgelegten Bewertungselementen und wird von externen Preisanbietern, Market Makern oder internen Modellen bezogen.

Der nicht realisierte Wertzuwachs/(Wertverlust) ist jeweils in der Aufstellung des Nettovermögens unter „Nicht realisierter Gewinn aus Swaps“ und „Nicht realisierter Verlust aus Swaps“ aufgeführt. Die daraus resultierenden realisierten Gewinne/(Verluste) und Veränderungen des nicht realisierten Wertzuwachses/(Wertverlusts) sind jeweils in der Aufwands- und Ertragsrechnung und den Veränderungen des Nettovermögens unter „Realisierter Gewinn/(Verlust) aus Derivaten“ und „Veränderung des nicht realisierten Bewertungsergebnisses aus Derivaten“ aufgeführt.

##### *Organismen für gemeinsame Anlagen*

Anteile am Teilfonds eines offenen Investmentfonds werden mit ihrem letzten verfügbaren Nettoinventarwert, abzüglich der zutreffenden Gebühren, bewertet.

# Erläuterungen zum Abschluss

## für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

### 2. Rechnungslegungsgrundsätze (Fortsetzung)

#### b) Bewertung von Vermögenswerten und Wertpapieren (Fortsetzung)

##### Geldmarktanlagen

Die Gesellschaft bewertet ihr Portfolio von Finanzinstrumenten, das aus kurzfristigen Schuldpapieren (wie Commercial Paper, Einlagenzertifikate und Schatzwechsel) besteht, zu fortgeführten Anschaffungskosten. Ferner wird die Gesellschaft in dem seltenen Fall, dass ein festverzinsliches Instrument mit einer Restlaufzeit von über 90 Tagen schwer verkäuflich wird, dieses effektiv zu fortgeführten Anschaffungskosten bewerten, bis es entweder verkauft wird oder der betreffende Markt wieder Aktivität aufweist.

##### Hypothekengebundene Wertpapiere – To-Be-Announced-Wertpapiere (TBA)

TBA-Positionen beziehen sich auf die am Markt für hypothekarisch besicherte Wertpapiere gängige Praxis, wonach ein Wertpapier an einem späteren Termin zu einem festgelegten Preis von einem Hypothekenpool (z. B. Ginnie Mae, Fannie Mae oder Freddie Mac) gekauft wird. Zum Zeitpunkt des Erwerbs ist das genaue Papier noch nicht bekannt, seine Hauptmerkmale sind jedoch festgelegt. Obwohl der Preis beim Erwerb vereinbart wurde, steht der Nennwert noch nicht abschließend fest. TBA-Positionen werden in der Aufstellung der Wertpapierbestände und des sonstigen Nettovermögens aufgeführt. Der Kauf dieser Art von Wertpapier wurde noch nicht abgewickelt. Folglich wird der Betrag, der der fälligen Zahlung bei Abwicklung der Transaktion entspricht, unter „Verbindlichkeiten aus dem Kauf von Wertpapieren“ in der Aufstellung des Nettovermögens aufgeführt. Negative Positionen in der Aufstellung der Wertpapierbestände und des sonstigen Nettovermögens spiegeln die TBA-Verkaufsverpflichtungen des Fonds wider. Der Betrag, der den fälligen Forderungen bei Abwicklung der Transaktion entspricht, wird unter „Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren“ in der Aufstellung des Nettovermögens aufgeführt. Realisierte Gewinne/(Verluste) aus TBA und Veränderungen des nicht realisierten Wertzuwachses/(Wertverlusts) sind in der Aufwands- und Ertragsrechnung und den Veränderungen des Nettovermögens jeweils unter „Realisierter Gewinn/(Verlust) aus Wertpapieren“ und „Veränderung des nicht realisierten Bewertungsergebnisses aus Wertpapieren“ ausgewiesen.

#### c) Erträge und Aufwendungen

Dividenden werden am Tag der Notierung ex Dividende verbucht. Die Dividenden nach Abzug von Quellensteuern sind in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und den Veränderungen des Nettovermögens unter dem Punkt „Anlageerträge, netto“ enthalten.

Zinserträge aus Schuldtiteln werden auf täglicher Basis verbucht. Bei Schuldverschreibungen, die zu einem Abschlag oder Aufschlag auf ihren Fälligkeitwert begeben wurden, wird der Gesamtertrag aus diesen Wertpapieren auf die Laufzeit dieses Wertpapiers umgelegt. Die Abschreibung dieses Abschlags oder Aufschlags erfolgt auf Basis des Effektivzinssatzes. Zinserträge von Anleihen werden nach der Effektivzinsmethode verbucht. Zinserträge aus Schuldtiteln sind in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und den Veränderungen des Nettovermögens unter dem Punkt „Anlageerträge, netto“ enthalten.

Zinserträge/Aufwand von Zinsswap-Kontrakten (IRS) werden auf täglicher Basis verbucht. Zinserträge/Aufwand von Zinsswap-Kontrakten (IRS) sind in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und den Veränderungen des Nettovermögens unter dem Punkt „Anlageerträge, netto“ enthalten.

#### d) Devisen

Die Kosten der Wertpapieranlagen, die Erträge und Aufwendungen, die nicht auf die Abrechnungswährung des betreffenden Teilfonds lauten, wurden zum geltenden Devisenkurs zum Zeitpunkt der Transaktion umgerechnet. Der Börsenkurs von Wertpapieren wie auch der anderen Aktiva und Passiva, die auf andere Währungen als die Konsolidierungswährung lauten, wurden anhand der Wechselkurse umgerechnet, die am 31. März 2024 galten.

#### e) Realisierter Gewinn/(Verlust) aus Kapitalanlagen

Der realisierte Gewinn/(Verlust) aus dem Verkauf von Wertpapieren ist die Differenz zwischen den historischen Durchschnittskosten der Wertpapiere und den Verkaufserlösen (ausschließlich etwaiger Transaktionsausgaben, wie in Erläuterung 5 näher erklärt).

Der in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und den Veränderungen des Nettovermögens des Russia Equity Teilfonds (der seit dem 25. Februar 2022 ausgesetzt ist) ausgewiesene realisierte Verlust aus Wertpapieranlagen in Höhe von 5.404.501 USD ist hauptsächlich auf den Erlös aus dem Verkauf von 346.508 Anteilen des Wertpapiers POLYMETAL INTERNATIONAL am 12. Juli 2023 zum Preis von 2,05 GBP zurückzuführen..

Das Wertpapier steht nicht auf der Liste der sanktionierten Vermögenswerte, die vom Office of Foreign Assets Control (OFAC) des US-Finanzministeriums herausgegeben wurde. Der Verkauf der Transaktion erfolgte im besten Interesse der Anleger des Fonds.

#### f) Fremdwährungsumrechnung

Die Referenzwährung des Fonds ist der USD und die konsolidierte Erfolgsrechnung wird in dieser Währung ausgedrückt. Die Bücher und Aufzeichnungen der Teilgesellschaftsvermögen werden in der Referenzwährung des jeweiligen Teilgesellschaftsvermögens geführt.

Erträge und Aufwendungen, Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die auf eine andere Währung als die Bezugswährung des Fonds lauten, werden nach dem zum Ende des Geschäftsjahres geltenden Wechselkurs umgerechnet.

# Erläuterungen zum Abschluss

## für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

### 2. Rechnungslegungsgrundsätze (Fortsetzung)

#### f) Fremdwährungsumrechnung (Fortsetzung)

Dies sind die zum Ende des Geschäftsjahres verwendeten hauptsächlichen Wechselkurse.

1 USD = EUR 0,925926

SGD 1,3496

#### g) Getrennte Haftung

Die Gesellschaft sieht eine getrennte Haftung der Teilfonds vor, d. h., das Vermögen eines Teilfonds steht ausschließlich zur Befriedigung der Ansprüche der Anteilinhaber des betreffenden Teilfonds und der Ansprüche von Gläubigern zur Verfügung, deren Ansprüche in Verbindung mit der Auflegung, Betreibung und Auflösung des betreffenden Teilfonds entstanden sind.

#### h) Wertpapierleihe

Die Gesellschaft kann Wertpapierleihgeschäfte tätigen, bei denen eine Partei Wertpapiere vorbehaltlich der Verpflichtung überträgt, dass der Leihnehmer gleichwertige Wertpapiere an einem zukünftigen Datum oder bei Aufforderung durch den Übertragenden zurückgibt. Ein solches Geschäft wird für die Partei, die die Wertpapiere überträgt, als Wertpapierverleihe und für den Kontrahenten, an den sie übertragen werden, als Wertpapierleihe angesehen.

Die Gesellschaft muss sicherstellen, dass sie verliehene Wertpapiere jederzeit zurückerufen oder alle Wertpapierleihgeschäfte, die sie abgeschlossen hat, jederzeit kündigen kann.

Alle Erträge (abzüglich Transaktionskosten) aus Wertpapierleihgeschäften fließen dem jeweiligen Teilfonds zu, basierend auf von der Wertpapierleihstelle bestätigten Angaben.

Einzelheiten zu den Wertpapierleihgeschäften sind im der Erläuterung 11 des aktuellen Berichts aufgeführt.

Zur Absicherung dieser Transaktion erhält der betreffende Teilfonds Sicherheiten. Die ausgeliehenen Wertpapiere werden an einen externen Makler geliefert, wobei die verliehenen Vermögenswerte weiterhin als Teil des Portfolios des betreffenden Teilfonds bewertet werden. Bei Beendigung einer Ausleihe ist der betreffende Teilfonds verpflichtet, die gestellten Sicherheiten an den Leihnehmer zurückzugeben. Diese Vergütung ist in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und den Veränderungen des Nettovermögens unter dem Punkt „Anlageerträge, netto“ enthalten.

#### i) Spot-Devisentransaktionen

Zum 31. März 2024 noch nicht abgewickelte Spot-Devisentransaktionen werden in der Aufstellung des Nettovermögens unter „Forderungen aus nicht abgewickelten Spot-Devisentransaktionen“ und „Verbindlichkeiten aus nicht abgewickelten Spot-Devisentransaktionen“ ausgewiesen.

#### j) Bestandsprovisionen und Rückvergütungen

Die Gesellschaft zahlt der Verwaltungsgesellschaft Verwaltungsgebühren. Bestandsprovisionen werden entweder aus den Verwaltungsgebühren entnommen oder die Verwaltungsgesellschaft weist die Gesellschaft an, einen Anteil der Verwaltungsgebühren direkt aus den Vermögenswerten eines Teilfonds an einen ausgewiesenen Vermittler zu zahlen. In beiden Fällen werden die fälligen Verwaltungsgebühren entsprechend reduziert.

### 3. Anteilskapital

Die Gesellschaft gab Anlegern Anteile der Klassen A, B, E, F, I, J, K, L, M, N, P, R, S, SP, T, U, W, X, Y, YP, Z und ZP an einem oder mehreren Teilfonds aus, wie unten näher erläutert.

Die Gesellschaft ist berechtigt, innerhalb jeder Anteilsklasse eines Teilfonds verschiedene Anteilunterklassen zu bilden, die sich in ihrer Ausschüttungspolitik (thesaurierende (C) und ausschüttende (D) Anteile), ihrer Referenzwährung und ihren Absicherungsaktivitäten (H) und/oder in anderen Merkmalen, die vom Verwaltungsrat festgelegt werden, unterscheiden.

Die Anteile aller Klassen sind als „thesaurierende“ und „ausschüttende“ Anteile erhältlich.

| Klasse   | Beschreibung  |     | Mindestbetrag der Erstanlage<br>Mindestbestand<br>(in US-Dollar oder Gegenwert in einer<br>Hauptwährung) |
|----------|---|-----|--|
|          |   |     | 5.000  |
| Klasse A | Anteile der Klasse A stehen allen Anlegern zur Verfügung. | USD | Sofern im Prospekt keine anderen<br>Angaben zu den Teilfonds gemacht<br>werden                           |

# Erläuterungen zum Abschluss

## für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

### 3. Anteilskapital (Fortsetzung)

| Klasse    | Beschreibung  |     | Mindestbetrag der Erstanlage<br>Mindestbestand<br>(in US-Dollar oder<br>Gegenwert in einer<br>Hauptwährung) |
|-----------|---|-----|---|
| Klasse B  | <p>Anteile der Klasse B stehen zur Verfügung für:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Untervertriebsstellen, denen es aufgrund geltender Gesetze und Vorschriften oder Gerichtsurteile, z. B. im Vereinigten Königreich oder in den Niederlanden, verboten ist, Anreize von Dritten anzunehmen und einzubehalten; oder</li> <li>• Untervertriebsstellen, die mit ihren Kunden eine gesonderte Gebührenregelung für die Erbringung von Wertpapierdienstleistungen und -tätigkeiten geschlossen haben (z. B. Dienstleistungen und Tätigkeiten im Rahmen von MiFID II in der Europäischen Union) und die sich dafür entschieden haben, keine Anreize von Dritten anzunehmen und einzubehalten.</li> </ul> | USD | 5.000<br>Sofern im Prospekt keine anderen Angaben zu den Teilfonds gemacht werden                           |
| Klasse E  | Anteile der Klasse E sind in bestimmten Ländern, vorbehaltlich der Genehmigung der zuständigen Aufsichtsbehörden, über von der globalen Vertriebsgesellschaft ausgewählte Vertriebsstellen erhältlich. Für Anteile der Klasse E werden jährliche Verwaltungsgebühren berechnet, die jenen der Anteile der Klasse A entsprechen, zuzüglich 0,3 % bis 0,5 % p. a. des Nettoinventarwerts der Anteile der Klasse E, die unter Umständen in gewissen Ländern an die ausgewählten Vertriebsstellen zu entrichten sind.   | USD | 5.000<br>Sofern im Prospekt keine anderen Angaben zu den Teilfonds gemacht werden                           |
| Klasse F  | Anteile der Klasse F stehen Anlegern zur Verfügung, die mit einem Unternehmen der HSBC-Gruppe einen Verwaltungsvertrag mit Dispositionsbefugnis geschlossen haben, und Anlegern, die über von der globalen Vertriebsgesellschaft ausgewählte Vertriebsstellen zeichnen, sofern die Anleger die Voraussetzungen als institutionelle Anleger im Sinne von Artikel 174 des Gesetzes von 2010 erfüllen.   | USD | 1.000.000<br>Sofern im Prospekt keine anderen Angaben zu den Teilfonds gemacht werden                       |
| Klasse I  | Anteile der Klasse I sind auf Antrag für alle Anleger an die Gesellschaft über von der Vertriebsgesellschaft ausgewählte Vertriebsstellen erhältlich.   | USD | 1.000.000   |
| Klasse J* | Anteile der Klasse J sind für Dachfonds verfügbar, die von der HSBC-Gruppe oder von bestimmten, von der globalen Vertriebsgesellschaft ausgewählten Rechtssubjekten verwaltet werden.   | USD | 100.000<br>Sofern im Prospekt keine anderen Angaben zu den Teilfonds gemacht werden                         |
| Klasse K  | K-Anteile stehen Versicherungsgesellschaften der HSBC-Gruppe zur Verfügung, die institutionelle Anleger im Sinne von Artikel 174 des Gesetzes von 2010 sind.  | USD | 1.000.000<br>Sofern im Prospekt keine anderen Angaben zu den Teilfonds gemacht werden                       |
| Klasse L* | Anteile der Klasse L sind über von der globalen Vertriebsgesellschaft ausgewählte Vertriebsstellen erhältlich, sofern die Anleger die Voraussetzungen als institutionelle Anleger im Sinne von Artikel 174 des Gesetzes von 2010 erfüllen.  | USD | 1.000.000   |
| Klasse M* | Anteile der Klasse M stehen allen Anlegern zur Verfügung.   | USD | 5.000<br>Sofern im Prospekt keine anderen Angaben zu den Teilfonds gemacht werden                           |
| Klasse N* | <p>Anteile der Klasse N stehen zur Verfügung für:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Untervertriebsstellen, denen es aufgrund geltender Gesetze und Vorschriften oder Gerichtsurteile, z. B. im Vereinigten Königreich oder in den Niederlanden, verboten ist, Anreize von Dritten anzunehmen und einzubehalten; oder</li> <li>• Untervertriebsstellen, die mit ihren Kunden eine gesonderte Gebührenregelung für die Erbringung von Wertpapierdienstleistungen und -tätigkeiten geschlossen haben (z. B. Dienstleistungen und Tätigkeiten im Rahmen von MiFID II in der Europäischen Union) und die sich dafür entschieden haben, keine Anreize von Dritten anzunehmen und einzubehalten.</li> </ul> | USD | 5.000   |

# Erläuterungen zum Abschluss

für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## 3. Anteilskapital (Fortsetzung)

| Klasse     | Beschreibung   |     | Mindestbetrag der Erstanlage<br>Mindestbestand<br>(in US-Dollar oder<br>Gegenwert in einer<br>Hauptwährung) |
|------------|--|-----|---|
| Klasse P   | Anteile der Klasse P stehen auf Antrag an die Gesellschaft in bestimmten Ländern oder über bestimmte, von der globalen Vertriebsgesellschaft ausgewählte Vertriebsstellen zur Verfügung.   | USD | 50.000<br>Sofern im Prospekt keine anderen Angaben zu den Teilfonds gemacht werden                          |
| Klasse R*  | Anteile der Klasse R sind in bestimmten Ländern, vorbehaltlich der Genehmigung der zuständigen Aufsichtsbehörden, über von der globalen Vertriebsgesellschaft auf Antrag der Gesellschaft ausgewählte Vertriebsstellen erhältlich. Für Anteile der Klasse R werden jährliche Verwaltungsgebühren berechnet, die jenen der Anteile der Klasse M entsprechen, zuzüglich 0,3 % bis 0,5 % p. a. des Nettoinventarwerts der Anteile der Klasse R, die unter Umständen in gewissen Ländern an bestimmte Vertriebsstellen zu entrichten sind.                                 | USD | 5.000<br>Sofern im Prospekt keine anderen Angaben zu den Teilfonds gemacht werden                           |
| Klasse S** | Anteile der Klasse S sind in gewissen Ländern oder über von der globalen Vertriebsgesellschaft ausgewählte Vertriebsstellen erhältlich, sofern die Anleger die Voraussetzungen als institutionelle Anleger im Sinne von Artikel 174 des Gesetzes von 2010 erfüllen.  | USD | 100.000<br>Sofern im Prospekt keine anderen Angaben zu den Teilfonds gemacht werden                         |
| Klasse SP  | Anteile der Klasse SP sind in bestimmten Ländern und/oder über von der globalen Vertriebsstelle ausgewählte Vertriebsstellen erhältlich, sofern die Anleger die Voraussetzungen als institutionelle Anleger im Sinne von Artikel 174 des Gesetzes von 2010 erfüllen.   | USD | 25.000.000<br>Sofern keine anderen Angaben zu den Teilfonds gemacht werden im Prospekt                      |
| Klasse T   | Anteile der Klasse T stehen allen Anlegern zur Verfügung.<br>T-Anteile stehen zulässigen Anlegern zur Verfügung, bis das verwaltete Vermögen des verbundenen Teilfonds einen vorab festgelegten Grenzwert erreicht. An diesem Punkt werden die T-Anteile für weitere Zeichnungen oder den Umtausch durch neue und bestehende Anleger geschlossen. T-Anteile stehen den Anlegern wieder zur Verfügung, falls das verwaltete Vermögen eines Teilfonds unter diesen Schwellenwert fällt oder der Verwaltungsrat dies in eigenem Ermessen beschließt.                      | USD | 5.000   |
| Klasse U   | Anteile der Klasse U sind auf Antrag für alle Anleger an die Gesellschaft über von der Vertriebsgesellschaft ausgewählte Vertriebsstellen erhältlich.  | USD | 30.000.000<br>Sofern keine anderen Angaben zu den Teilfonds gemacht werden im Prospekt                      |
| Klasse W   | Anteile der Klasse W sind über Vertriebsstellen erhältlich, die auch Mitglieder oder verbundene Unternehmen der HSBC-Gruppe sind und von der globalen Vertriebsgesellschaft ausgewählt wurden, sofern die Anleger die Voraussetzungen als institutionelle Anleger im Sinne von Artikel 174 des Gesetzes von 2010 erfüllen. Für die Anteile der Klasse W fallen keine Betriebskosten, Verwaltungs- und Kontoführungsgebühren an. Sämtliche Gebühren und Kosten dieser Klasse werden direkt von den Mitgliedern oder verbundenen Unternehmen der HSBC-Gruppe übernommen. | USD | 100.000<br>Sofern keine anderen Angaben zu den Teilfonds gemacht werden im Prospekt                         |

# Erläuterungen zum Abschluss

für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## 3. Anteilskapital (Fortsetzung)

| Klasse     | Beschreibung   |     | Mindestbetrag der Erstanlage<br>Mindestbestand<br>(in US-Dollar oder<br>Gegenwert in einer<br>Hauptwährung) |
|------------|--|-----|---|
| Klasse X   | Anteile der Klasse X sind über von der globalen Vertriebsstelle ausgewählte Vertriebsstellen erhältlich, sofern die Anleger die Voraussetzungen als institutionelle Anleger im Sinne von Artikel 174 des Gesetzes von 2010 erfüllen und in eine der folgenden Kategorien fallen: Unternehmen oder Pensionskassen von Unternehmen, Versicherungsgesellschaften, eingetragene wohltätige Einrichtungen, von einer Gesellschaft der HSBC-Gruppe verwaltete oder beratene Fonds oder sonstige vom Verwaltungsrat genehmigte institutionelle Anleger. | USD | 10.000.000<br>Sofern im Prospekt keine anderen Angaben zu den Teilfonds gemacht werden                      |
| Klasse Y   | Anteile der Klasse Y sind in bestimmten Ländern über auf Antrag der Gesellschaft von der globalen Vertriebsgesellschaft beauftragte Vertriebsstellen erhältlich.   | USD | 1.000   |
| Klasse YP* | Anteile der Klasse YP sind in bestimmten Ländern über auf Antrag der Gesellschaft von der globalen Vertriebsgesellschaft beauftragte Vertriebsstellen erhältlich.  | USD | 1.000   |
| Klasse Z   | Anteile der Klasse Z stehen Anlegern zur Verfügung, die mit einem Unternehmen der HSBC-Gruppe einen Verwaltungsvertrag mit Dispositionsbefugnis geschlossen haben, und Anlegern, die über von der globalen Vertriebsgesellschaft ausgewählte Vertriebsstellen zeichnen, sofern die Anleger die Voraussetzungen als institutionelle Anleger im Sinne von Artikel 174 des Gesetzes von 2010 erfüllen.  | USD | 1.000.000   |
| Klasse ZP* | Anteile der Klasse ZP stehen Anlegern zur Verfügung, die mit einem Unternehmen der HSBC-Gruppe einen Verwaltungsvertrag mit Dispositionsbefugnis geschlossen haben, und Anlegern, die über von der globalen Vertriebsgesellschaft ausgewählte Vertriebsstellen zeichnen, sofern die Anleger die Voraussetzungen als institutionelle Anleger im Sinne von Artikel 174 des Gesetzes von 2010 erfüllen.   | USD | 1.000.000   |

\* Die aufeinander folgenden Anteilsklassen J, L, M, R, YP und ZP eines Teilfonds können mit 1, 2, 3... nummeriert und als J1, J2, J3 (...), L1, L2, L3 (...), M1, M2, M3 (...), N1, N2, N3 (...), R1, R2, R3 (...), YP1, YP2, YP3 (...) und ZP1, ZP2, ZP3 bezeichnet werden (...).

\*\* Aufeinander folgende S-Anteilsklassen werden in einem oder verschiedenen Teilfonds ausgegeben, mit 1, 2, 3 usw. nummeriert und als S1, S2, S3 usw. für die jeweilige S-Klasse, die im ersten, zweiten bzw. dritten Teilfonds aufgelegt wird, bezeichnet.

Der Verwaltungsrat ist befugt, unterschiedliche Anteilsklassen in einem oder mehreren Teilfonds auszugeben. Die Merkmale dieser Anteilsklassen, die angeboten werden, werden vom Verwaltungsrat nach freiem Ermessen festgelegt. Im Falle der Auflegung weiterer Anteilsklassen wird der Prospekt aktualisiert.

Die Zeichnungserlöse aus allen Anteilen eines Teilfonds werden in einen gemeinsamen zugrunde liegenden Wertpapierbestand angelegt. Alle Anteile derselben Klasse haben dieselben Rechte und Privilegien. Jeder ausgegebene Anteil ist im Falle einer Liquidation zur gleichen Beteiligung am Vermögen der relevanten Klasse des Teilfonds, zu dem er gehört, und zum Erhalt von Dividenden und anderen Ausschüttungen berechtigt, die für den Teilfonds festgesetzt werden. Die Anteile sind nicht mit Vorzugs- oder Vorkaufsrechten ausgestattet, und jeder volle Anteil verleiht Anspruch auf eine Stimme bei allen Versammlungen der Anteilinhaber.

# Erläuterungen zum Abschluss

## für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

### 3. Anteilskapital (Fortsetzung)

Der Verwaltungsrat kann das Stimmrecht eines Anteilhabers aussetzen, wenn dieser seinen Verpflichtungen gemäß der Satzung und/oder einem Dokument (einschließlich Antragsformularen), in dem seine Verpflichtungen gegenüber der Gesellschaft und/oder den anderen Anteilhabern aufgeführt sind, nicht nachkommt. Wenn die Stimmrechte eines oder mehrerer Anteilhaber gemäß dem obigen Absatz ausgesetzt sind, werden die betreffenden Anteilhaber zwar zu den Hauptversammlungen eingeladen und können an diesen teilnehmen, ihre Anteile werden jedoch bei der Feststellung der Beschlussfähigkeit und der Mehrheitserfordernisse nicht berücksichtigt. Anteilhaber können (persönlich) beschließen, alle oder einen Teil der Stimmrechte aus ihren Anteilen vorübergehend oder dauerhaft nicht auszuüben.

Der Mindestanlagebetrag kann im Ermessen des Verwaltungsrats der Gesellschaft erlassen oder reduziert werden.

Zuordnung zu Anteilsklassen und aufeinander folgenden Klassen:

Den für die verschiedenen Teilfonds ausgegebenen Anteilsklassen wird ein Klassenname zugewiesen, dem die Vertriebsmerkmale und, wenn zutreffend, die Absicherungspolitik und die Währung, in der die Basiswährung abgesichert ist, folgen. Beispiel: Ausschüttende Anteile der Klasse A, abgesichert gegenüber dem Euro, wie oben definiert, werden als ADHEUR gekennzeichnet, während thesaurierende Anteile der Klasse I mit IC gekennzeichnet werden.

Ausschüttende Anteile werden mit einem „D“ nach der Bezeichnung des Teilfonds und der Anteilsklasse (z. B. Klasse AD) gekennzeichnet, mit Ausnahme der monatlich ausschüttenden Anteile, die mit einem „M“ nach der Bezeichnung des Teilfonds und der Anteilsklasse gekennzeichnet sind (z. B. Klasse AM), der Anteile mit Ausschüttung alle zwei Monate, die mit einem „B“ nach der Bezeichnung des Teilfonds und der Anteilsklasse gekennzeichnet sind (z. B.: Klasse AB), der Anteile mit vierteljährlicher Ausschüttung, die mit einem „Q“ nach der Bezeichnung des Teilfonds und der Anteilsklasse gekennzeichnet sind (z. B.: Klasse AQ) und Anteile mit halbjährlicher Ausschüttung mit einem „S“ nach der Bezeichnung des Teilfonds und der Anteilsklasse (z. B.: Klasse AS).

Innerhalb jeder Anteilsklasse eines Teilfonds können getrennte, gegenüber einer Währung abgesicherte Klassen ausgegeben werden (bezeichnet mit „H“ oder „O“ und der Währung, gegenüber der die Basiswährung oder die Währung, in der die Vermögenswerte des Teilfonds überwiegend investiert sind, abgesichert ist. Diese währungsabgesicherten Anteilsklassen werden wie folgt bezeichnet: „ACHEUR“ oder „ACOEUR“ für eine in Euro abgesicherte thesaurierende Anteilsklasse). Die von der Verwaltungsstelle oder anderen ernannten Parteien für die Absicherung in einer Währung erhobenen Gebühren werden von der jeweiligen, gegenüber einer Währung abgesicherten Klasse übernommen. Diese Gebühren fallen zusätzlich zu den Betriebskosten, Verwaltungs- und Kontoführungsgebühren an, die nachstehend näher beschrieben werden. Jegliche Gewinne oder Verluste werden ebenfalls der entsprechenden in einer Währung abgesicherten Klasse zugewiesen.



# Erläuterungen zum Abschluss

## für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

### 4. Gebühren und Kosten

#### a) Erklärung der Gebührenstruktur

Eine Kapitalanlage in der Gesellschaft wird in der Regel über Gebührenstrukturen angeboten, entsprechend den Anteilsklassen A, B, E, F, I, J, K, L, M, N, P, R, S, SP, T, U, W, X, Y, YP, Z und ZP.

HSBC Investment Funds (Luxembourg) S.A. (die „Verwaltungsgesellschaft“) hat zudem in Bezug auf jede Anteilsklasse Anspruch auf eine Verwaltungsgebühr für die Anlageverwaltungs-, Anlageberatungs- und Vertriebsdienstleistungen, die sie für die einzelnen Klassen erbringt (siehe Absatz (b) „Verwaltungsgebühr“ unten).

Ferner bezahlt die Gesellschaft der Verwaltungsgesellschaft eine Gebühr zur Deckung von Betriebskosten, Verwaltungs- und Kontoführungsgebühren. Um die Anteilinhaber gegen Änderungen der Betriebskosten, Verwaltungs- und Kontoführungsgebühren der Teilfonds zu schützen, hat die Gesellschaft mit der Verwaltungsgesellschaft vereinbart, dass die zur Deckung dieser Betriebskosten, Verwaltungs- und Kontoführungsgebühren erhobene Gebühr mit einem Jahressatz festgelegt wird.

Kosten, die unter Umständen höher sind als dieser Jahressatz, werden von der Verwaltungsgesellschaft übernommen (siehe Absatz (e) „Betriebskosten, Verwaltungs- und Kontoführungsgebühren/Gebühren für die Währungsabsicherung“ unten).

#### b) Verwaltungsgebühr

Die Gesellschaft bezahlt der Verwaltungsgesellschaft für jeden Teilfonds eine Gebühr in Höhe eines Prozentsatzes des Nettovermögens des jeweiligen Teilfonds, wie in der nachstehenden Tabelle angegeben (die „Verwaltungsgebühren“). Diese Gebühr wird täglich berechnet und ist monatlich rückwirkend in Höhe der in der folgenden Tabelle aufgeführten Sätze zu zahlen.

|  | Klasse A | Klasse B | Klasse E | Klasse F | Klasse I | Klasse J | Klasse K | Klasse L | Klasse M | Klasse N | Klasse P | Klasse R | Klasse S | Klasse SP | Klasse T | Klasse U | Klasse W | Klasse X | Klasse Y | Klasse Z | Klasse ZP |
|--|----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|-----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|-----------|
| <b>AKTIENTEILFONDS</b>                     |          |          |          |          |          |          |          |          |          |          |          |          |          |           |          |          |          |          |          |          |           |
| a) Aktienteilfonds                         |          |          |          |          |          |          |          |          |          |          |          |          |          |           |          |          |          |          |          |          |           |
| ASEAN Equity                               | 1,500    | 0,750    | 2,000    | 0,375    | 0,750    | 0,600    | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -         | -        | -        | 0,000    | 0,700    | -        | 0,000    | -         |
| Asia ex Japan Equity                       | 1,500    | 0,750    | 2,000    | 0,375    | 0,750    | 0,600    | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -        | 0,450     | -        | -        | 0,000    | 0,700    | -        | 0,000    | -         |
| Asia ex Japan Equity Smaller Companies     | 1,500    | 0,750    | 2,000    | 0,375    | 0,750    | 0,600    | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -        | 0,450     | -        | -        | 0,000    | 0,700    | -        | 0,000    | -         |
| Asia Pacific ex Japan Equity High Dividend | 1,500    | 0,750    | 2,000    | 0,375    | 0,750    | 0,600    | -        | -        | -        | -        | -        | -        | *        | 0,450     | -        | -        | 0,000    | 0,700    | -        | 0,000    | -         |
| China A-Shares Equity                      | 1,500    | 0,750    | 2,000    | 0,375    | 0,750    | 0,600    | -        | -        | -        | -        | -        | -        | 0,500**  | 0,450     | -        | -        | 0,000    | 0,700    | -        | 0,000    | -         |
| Chinese Equity                             | 1,500    | 0,750    | 2,000    | 0,375    | 0,750    | 0,600    | -        | -        | -        | -        | -        | -        | 0,550^   | 0,450     | -        | -        | 0,000    | 0,700    | -        | 0,000    | -         |
| Euroland Equity Smaller Companies          | 1,500    | 0,750    | 2,000    | 0,375    | 0,750    | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -        | 0,325^^  | 0,450     | -        | -        | 0,000    | 0,700    | -        | 0,000    | -         |
| Euroland Growth                            | 1,500    | 0,750    | 2,000    | 0,375    | 0,750    | -        | -        | -        | 1,250    | -        | -        | -        | -        | 0,450     | -        | -        | 0,000    | 0,700    | -        | 0,000    | -         |
| Euroland Value                             | 1,500    | 0,750    | 2,000    | 0,375    | 0,750    | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -        | 0,450     | -        | -        | 0,000    | 0,600    | -        | 0,000    | -         |
| Europe Value                               | 1,500    | 0,750    | 2,000    | 0,375    | 0,750    | -        | -        | -        | -        | -        | 1,000    | -        | -        | 0,450     | -        | -        | 0,000    | 0,600    | -        | 0,000    | -         |

+ Bis zum 31. Juli 2023 lautete der Name des Teilfonds „Thai Equity“.

\* 0,350 % für Anteilsklasse S9, 1,100 % für Anteilsklasse S45, 1,300 % für Anteilsklasse S48

\*\* 0,500 % für Anteilsklasse S34,

^0,550 % für Anteilsklasse S43.

^^0,325 % für Anteilsklasse S33

# Erläuterungen zum Abschluss

für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## 4. Gebühren und Kosten (Fortsetzung)

### b) Verwaltungsgebühr (Fortsetzung)

| Teilfonds   | Klasse A | Klasse B | Klasse E | Klasse F | Klasse I | Klasse J | Klasse K | Klasse L | Klasse M | Klasse N | Klasse P | Klasse R | Klasse S              | Klasse SP | Klasse T | Klasse U | Klasse W | Klasse X | Klasse Y | Klasse Z | Klasse ZP |
|---|----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|-----------------------|-----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|-----------|
| a) Aktienteilfonds (Fortsetzung)                                  |          |          |          |          |          |          |          |          |          |          |          |          |                       |           |          |          |          |          |          |          |           |
| Global Emerging Markets Equity                                    | 1,500    | 0,750    | 2,000    | 0,375    | 0,750    | 0,600    | 1,000    | 0,500    | -        | -        | -        | 1,000    | 0,550 <sup>^</sup>    | -         | -        | -        | 0,000    | 0,700    | -        | 0,000    | -         |
| Global Equity Circular Economy                                    | 1,500    | 0,750    | 2,000    | 0,375    | 0,750    | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -                     | -         | -        | -        | 0,000    | 0,600    | -        | 0,000    | -         |
| Global Equity Climate Change                                      | 1,500    | 0,750    | 2,000    | 0,375    | 0,750    | 0,450    | -        | -        | -        | -        | -        | -        | 0,450 <sup>*</sup>    | -         | -        | -        | 0,000    | 0,600    | -        | 0,000    | -         |
| Global Equity Sustainable Healthcare                              | 1,500    | 0,750    | 2,000    | 0,375    | 0,750    | 0,550    | -        | -        | -        | -        | -        | 1,000    | 0,550 <sup>+</sup>    | -         | -        | -        | 0,000    | 0,600    | -        | 0,000    | -         |
| Global Infrastructure Equity                                      | 1,500    | 0,750    | 2,000    | 0,375    | 0,750    | 0,550    | -        | -        | -        | -        | -        | 1,000    | 0,300 <sup>++</sup>   | -         | -        | -        | 0,000    | 0,600    | -        | 0,000    | -         |
| Global Real Estate Equity   | 1,500    | 0,750    | 2,000    | 0,375    | 0,750    | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -                     | -         | -        | -        | 0,000    | 0,600    | -        | 0,000    | -         |
| Global Lower Carbon Equity  | 0,800    | 0,400    | 1,100    | 0,200    | 0,400    | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -                     | -         | -        | -        | 0,000    | 0,350    | -        | 0,000    | -         |
| Global Sustainable Equity Income                                  | 0,500    | 0,250    | 0,700    | 0,125    | 0,250    | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -                     | -         | -        | -        | 0,000    | 0,200    | -        | 0,000    | -         |
| Global Sustainable Long Term Dividend                             | 1,500    | 0,750    | 2,000    | 0,375    | 0,750    | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -                     | 0,450     | -        | -        | 0,000    | 0,600    | -        | 0,000    | -         |
| Global Sustainable Long Term Equity                               | 1,500    | 0,750    | 2,000    | 0,375    | 0,750    | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -                     | 0,450     | -        | -        | 0,000    | 0,600    | -        | 0,000    | -         |
| Hong Kong Equity  | 1,500    | 0,750    | 2,000    | 0,375    | 0,750    | 0,600    | -        | -        | -        | -        | -        | 1,000    | -                     | 0,450     | -        | -        | 0,000    | 0,700    | -        | 0,000    | -         |
| b) Internationale und regionale Aktienteilfonds                   |          |          |          |          |          |          |          |          |          |          |          |          |                       |           |          |          |          |          |          |          |           |
| BRIC Equity   | 1,500    | 0,750    | 2,000    | 0,375    | 0,750    | 0,600    | -        | 0,500    | 1,000    | -        | -        | -        | -                     | -         | -        | -        | 0,000    | 0,700    | -        | 0,000    | -         |
| BRIC Markets Equity   | 1,500    | 0,750    | 2,000    | 0,375    | 0,750    | 0,600    | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -                     | -         | -        | -        | 0,000    | 0,700    | -        | 0,000    | -         |
| Frontier Markets  | 1,750    | 1,250    | 2,250    | 0,625    | 1,250    | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -        | 0,500 <sup>+++</sup>  | -         | -        | -        | 0,000    | 1,000    | -        | 0,000    | -         |
| Global Equity Volatility Focused                                  | 0,800    | 0,400    | 1,100    | 0,200    | 0,400    | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -                     | 0,350     | -        | -        | 0,000    | 0,350    | -        | 0,000    | -         |
| c) Marktspezifische Aktienteilfonds                               |          |          |          |          |          |          |          |          |          |          |          |          |                       |           |          |          |          |          |          |          |           |
| Brazil Equity   | 1,750    | 0,875    | 2,250    | 0,437    | 0,875    | 0,600    | -        | -        | -        | -        | -        | -        | 0,550 <sup>###</sup>  | 0,450     | -        | -        | 0,000    | 0,700    | -        | 0,000    | -         |
| Economic Scale US Equity  | 0,600    | 0,300    | 0,900    | 0,150    | 0,300    | -        | -        | -        | -        | -        | 0,400    | -        | 0,550 <sup>####</sup> | -         | -        | -        | 0,000    | 0,300    | 0,150    | 0,000    | -         |
| Indian Equity   | 1,500    | 0,750    | 2,000    | 0,375    | 0,750    | 0,600    | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -                     | 0,450     | -        | -        | 0,000    | 0,700    | -        | 0,000    | -         |
| Mexico Equity (geschlossenen zum 28. Juli 2023)                   | 1,750    | 0,875    | 2,250    | 0,437    | 0,875    | 0,600    | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -                     | -         | -        | -        | 0,000    | 0,750    | -        | 0,000    | -         |
| Russia Equity <sup>^^</sup>                                       | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -                     | -         | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -         |
| Turkey Equity   | 1,750    | 0,875    | 2,250    | 0,437    | 0,875    | 0,600    | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -                     | -         | -        | -        | 0,000    | 0,700    | -        | 0,000    | -         |
| RENTENTEILFONDS   |          |          |          |          |          |          |          |          |          |          |          |          |                       |           |          |          |          |          |          |          |           |
| Asia Bond   | 1,100    | 0,550    | 1,400    | 0,275    | 0,550    | 0,600    | -        | -        | -        | -        | -        | -        | 0,250 <sup>#</sup>    | -         | -        | -        | 0,000    | 0,500    | -        | 0,000    | -         |
| Asia ESG Bond   | 1,100    | 0,550    | 1,400    | 0,275    | 0,550    | 0,600    | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -                     | -         | -        | -        | 0,000    | 0,500    | -        | 0,000    | -         |
| Asia High Yield Bond  | 1,250    | 0,625    | 1,550    | 0,312    | 0,625    | -        | -        | -        | -        | -        | 1,000    | -        | 0,300 <sup>##</sup>   | -         | -        | -        | 0,000    | 0,600    | -        | 0,000    | -         |
| Asian Currencies Bond   | 1,250    | 0,625    | 1,550    | 0,312    | 0,625    | 0,600    | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -                     | -         | -        | -        | 0,000    | 0,600    | -        | 0,000    | -         |
| Brazil Bond   | 1,000    | 0,500    | 1,300    | 0,250    | 0,500    | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -                     | -         | -        | -        | 0,000    | 0,500    | -        | 0,000    | -         |
| Corporate Euro Bond Fixed Term 2027 (aufgelegt zum 30. Juni 2023) | 0,600    | 0,300    | 0,900    | -        | 0,300    | -        | -        | -        | -        | -        | 0,400    | -        | -                     | -         | -        | -        | -        | 0,250    | -        | 0,000    | -         |
| Euro Bond   | 0,750    | 0,375    | 1,050    | 0,187    | 0,375    | 0,600    | -        | -        | -        | -        | 0,500    | -        | 0,150                 | -         | -        | -        | 0,000    | 0,300    | -        | 0,000    | -         |
| Euro Bond Total Return  | 0,900    | 0,450    | 1,200    | 0,225    | 0,450    | 0,600    | -        | -        | -        | -        | -        | -        | 0,200                 | -         | -        | -        | 0,000    | 0,400    | -        | 0,000    | -         |
| Euro Credit Bond  | 0,850    | 0,425    | 1,150    | 0,212    | 0,425    | 0,600    | -        | -        | -        | -        | -        | -        | 0,250                 | -         | -        | -        | 0,000    | 0,350    | -        | 0,000    | -         |
| Euro High Yield Bond  | 1,100    | 0,550    | 1,400    | 0,275    | 0,550    | 0,600    | -        | -        | -        | -        | -        | -        | 0,350                 | -         | -        | -        | 0,000    | 0,500    | -        | 0,000    | -         |
| ESG Short Duration Credit Bond                                    | 0,750    | 0,375    | 1,050    | 0,187    | 0,375    | -        | -        | -        | -        | -        | 0,560    | -        | -                     | -         | -        | -        | -        | 0,325    | -        | 0,000    | -         |
| GEM Debt Total Return   | 1,600    | 0,800    | 1,900    | 0,400    | 0,800    | 0,600    | -        | 0,500    | 1,000    | 0,500    | -        | 1,500    | **                    | -         | -        | -        | 0,000    | 0,750    | -        | 0,000    | -         |
| Global Bond   | 0,750    | 0,375    | 1,050    | 0,187    | 0,375    | 0,600    | -        | -        | -        | -        | 0,500    | -        | -                     | -         | -        | -        | 0,000    | 0,350    | -        | 0,000    | -         |
| Global Bond Total Return  | 0,900    | 0,450    | 1,200    | 0,225    | 0,450    | 0,600    | -        | -        | -        | -        | -        | -        | 0,200                 | -         | -        | -        | 0,000    | 0,400    | -        | 0,000    | -         |
| Global Corporate Bond   | 0,750    | 0,375    | 1,050    | 0,187    | 0,375    | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -        | 0,245                 | -         | -        | -        | 0,000    | 0,325    | -        | 0,000    | -         |
| Global Emerging Markets Bond                                      | 1,250    | 0,625    | 1,550    | 0,250    | 0,500    | 0,600    | -        | -        | -        | -        | 1,000    | -        | ***                   | -         | -        | -        | 0,000    | 0,500    | -        | 0,000    | -         |
| Global Emerging Markets Corporate Sustainable Bond                | 1,250    | 0,625    | 1,550    | 0,250    | 0,500    | 0,600    | -        | -        | -        | -        | 1,000    | -        | -                     | -         | -        | -        | 0,000    | 0,500    | -        | 0,000    | -         |
| Global Emerging Markets ESG Bond                                  | 1,250    | 0,625    | 1,550    | 0,250    | 0,500    | 0,600    | -        | -        | -        | -        | 1,000    | -        | -                     | -         | -        | -        | 0,000    | 0,500    | -        | 0,000    | -         |
| Global Emerging Markets ESG Local Debt                            | 1,250    | 0,625    | 1,550    | 0,312    | 0,625    | 0,600    | -        | -        | -        | -        | -        | -        | 0,300                 | -         | -        | -        | 0,000    | 0,600    | -        | 0,000    | -         |
| Global Emerging Markets Local Debt                                | 1,250    | 0,625    | 1,550    | 0,312    | 0,625    | 0,600    | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -                     | -         | -        | -        | 0,000    | 0,600    | -        | 0,000    | -         |
| Global ESG Corporate Bond   | 0,750    | 0,375    | 1,050    | 0,187    | 0,375    | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -                     | -         | -        | -        | 0,000    | 0,325    | -        | 0,000    | -         |
| Global Government Bond  | 0,600    | 0,300    | 0,900    | 0,150    | 0,300    | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -                     | -         | -        | -        | -        | 0,250    | -        | 0,000    | -         |
| Global Green Bond   | 0,750    | 0,375    | 1,050    | 0,187    | 0,375    | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -                     | -         | -        | -        | 0,000    | 0,325    | -        | 0,000    | -         |
| Global High Income Bond   | 1,250    | 0,625    | 1,550    | 0,312    | 0,625    | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -        | 0,350                 | -         | -        | -        | 0,000    | 0,350    | -        | 0,000    | -         |
| Global High Yield Bond  | 1,100    | 0,550    | 1,400    | 0,275    | 0,550    | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -                     | -         | -        | -        | 0,000    | 0,500    | -        | 0,000    | -         |
| Global High Yield ESG Bond  | 1,100    | 0,550    | 1,400    | 0,275    | 0,550    | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -                     | -         | -        | -        | 0,000    | 0,500    | -        | 0,000    | -         |
| Global High Yield Securitised Credit Bond                         | 1,500    | 0,750    | 2,000    | 0,375    | 0,750    | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -                     | -         | -        | -        | 0,000    | 0,700    | -        | 0,000    | -         |
| Global Inflation Linked Bond                                      | 0,700    | 0,350    | 1,000    | 0,175    | 0,350    | -        | -        | -        | -        | -        | 0,170    | -        | 0,200                 | -         | -        | -        | 0,000    | 0,350    | 0,540    | 0,000    | -         |
| Global Investment Grade Securitised Credit Bond                   | 0,900    | 0,450    | 1,200    | 0,225    | 0,450    | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -                     | -         | -        | -        | 0,000    | 0,450    | -        | 0,000    | -         |
| Global Lower Carbon Bond  | 0,800    | 0,400    | 1,100    | 0,200    | 0,400    | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -                     | -         | -        | -        | 0,000    | 0,350    | -        | 0,000    | -         |
| Global Securitised Credit Bond                                    | 1,300    | 0,650    | 1,800    | 0,325    | 0,650    | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -                     | -         | -        | -        | 0,000    | 0,600    | -        | 0,000    | -         |
| Global Short Duration Bond  | 0,500    | 0,250    | 0,800    | 0,125    | 0,250    | 0,600    | -        | -        | -        | -        | -        | -        | 0,150                 | -         | -        | -        | 0,000    | 0,200    | -        | 0,000    | -         |
| India Fixed Income  | 1,100    | 0,550    | 1,400    | 0,275    | 0,550    | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -                     | -         | -        | -        | 0,000    | 0,500    | -        | 0,000    | -         |
| RMB Fixed Income  | 0,750    | 0,375    | 1,050    | 0,187    | 0,375    | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -                     | -         | -        | -        | 0,000    | 0,350    | -        | 0,000    | -         |
| Singapore Dollar Income Bond                                      | 0,800    | 0,400    | 1,100    | 0,200    | 0,400    | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -                     | -         | -        | -        | 0,000    | 0,350    | -        | 0,000    | -         |
| Ultra Short Duration Bond   | 0,400    | 0,200    | -        | 0,100    | 0,200    | -        | -        | -        | -        | -        | 0,300    | -        | -                     | -         | -        | 0,150    | 0,000    | 0,150    | -        | 0,000    | -         |
| US Dollar Bond  | 0,750    | 0,375    | 1,050    | 0,187    | 0,375    | -        | -        | -        | -        | -        | 0,500    | -        | -                     | -         | -        | -        | 0,000    | 0,350    | -        | 0,000    | -         |
| US High Yield Bond  | 1,100    | 0,550    | 1,400    | 0,275    | 0,550    | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -        | 0,250 <sup>^^</sup>   | -         | -        | -        | 0,000    | 0,500    | -        | 0,000    | -         |
| US Short Duration High Yield Bond <sup>@</sup>                    | 0,900    | 0,450    | 1,300    | 0,225    | 0,450    | 0,600    | -        | -        | -        | -        | -        | -        | 0,200                 | -         | -        | -        | 0,000    | 0,400    | -        | 0,000    | -         |

@ Bis zum 2. Juli 2023 lautete der Name des Teilfonds „Global Short Duration High Yield Bond“.

\* 0,450 % für Anteilklasse S41.

\*\* 0,750 % für Anteilklasse S4; 0,400 % für Anteilklasse S21

\*\*\* 0,600 % für Anteilklasse S6; 0,280 % für Anteilklasse S20

+ 0,550 % für Anteilklasse S39.

++ 0,300 % für Anteilklasse S46.

+++ 0,500 % für Anteilklasse S36.

# Erläuterungen zum Abschluss

für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## 4. Gebühren und Kosten (Fortsetzung)

### b) Verwaltungsgebühr (Fortsetzung)

| Teilfonds  | Klasse A | Klasse B | Klasse E | Klasse F | Klasse I | Klasse J | Klasse K | Klasse L | Klasse M | Klasse N | Klasse P | Klasse R | Klasse S | Klasse SP | Klasse T | Klasse U | Klasse W | Klasse X | Klasse Y | Klasse Z | Klasse ZP |
|--|----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|-----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|-----------|
| <b>SONSTIGE TEILFONDS</b>  |          |          |          |          |          |          |          |          |          |          |          |          |          |           |          |          |          |          |          |          |           |
| Global Credit Floating Rate Fixed Term Bond 2023 – 1 (geschlossen zum 5. Juli 2023)      | 0,350    | 0,180    | -        | 0,150    | -        | -        | -        | -        | -        | -        | 0,270    | -        | -        | -         | -        | -        | 0,000    | -        | -        | 0,000    | -         |
| Global Credit Floating Rate Fixed Term Bond 2023 – 2 (geschlossen zum 29. Dezember 2023) | 0,350    | 0,180    | -        | 0,150    | -        | -        | -        | -        | -        | -        | 0,270    | -        | -        | -         | -        | -        | 0,000    | -        | -        | 0,000    | -         |
| Global Emerging Markets Multi-Asset Income   | 1,350    | 0,675    | 1,650    | 0,337    | 0,675    | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -         | -        | -        | 0,000    | 0,650    | -        | 0,000    | -         |
| Managed Solutions – Asia Focused Conservative  | 0,700    | 0,500    | 1,000    | 0,250    | 0,500    | -        | -        | -        | -        | -        | 0,800    | -        | -        | -         | -        | -        | 0,000    | 0,450    | -        | 0,000    | -         |
| Managed Solutions – Asia Focused Growth  | 1,500    | 0,750    | 2,000    | 0,375    | 0,750    | -        | -        | -        | -        | -        | 1,250    | -        | -        | -         | -        | -        | 0,000    | 0,600    | -        | 0,000    | -         |
| Managed Solutions – Asia Focused Income  | 1,250    | 0,625    | 1,550    | 0,312    | 0,625    | -        | -        | -        | -        | -        | 1,250    | -        | 1,190+   | -         | -        | -        | 0,000    | 0,600    | -        | 0,000    | -         |
| Multi-Asset Style Factors  | 1,400    | 0,700    | 1,900    | 0,350    | 0,700    | -        | 0,350    | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -         | -        | -        | 0,000    | 0,550    | -        | 0,000    | -         |
| Multi-Strategy Target Return   | 1,500    | 0,750    | 2,000    | 0,250    | 0,500    | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -         | -        | -        | 0,000    | 0,650    | -        | 0,000    | -         |
| US Income Focused  | 1,250    | 0,625    | 1,550    | 0,317    | 0,625    | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -        | -         | -        | -        | 0,000    | 0,600    | -        | 0,000    | -         |

+1,190 % für Anteilsklasse S49

Der Höchstsatz für Anteile der Klassen E, I, J, L, M und N beträgt 3,500 %.

Der Höchstsatz für die Anteile der Klassen A, B, K, P, R, S, X, Y, YP, Z und ZP wird im Prospekt angegeben.

Für die Anteile der Klasse W wird derzeit keine Verwaltungsgebühr erhoben.

Die Managementgebühr deckt die Anlageverwaltungs-, Anlageberatungs- und Vertriebsdienstleistungen, die dem jeweiligen Teilfonds der Gesellschaft von der Verwaltungsgesellschaft, von den Anlageberatern und den Anteilsvertriebsstellen erbracht werden. Die Verwaltungsgesellschaft ist dafür zuständig, aus dieser Gebühr die Kosten der Anlageberater und Anteilsvertriebsstellen zu bezahlen, und kann einen Teil dieser Gebühr für anerkannte Vermittler oder andere Personen aufwenden, die die Verwaltungsgesellschaft nach eigenem Ermessen bestimmt.

Die Verwaltungsgesellschaft kann die Gesellschaft anweisen, einen Teil der Verwaltungsgebühr direkt aus den Vermögenswerten der Gesellschaft an diese Dienstleistungsanbieter oder identifizierten Personen zu entrichten. In solchen Fällen wird die an die Verwaltungsgesellschaft zahlbare Verwaltungsgebühr entsprechend reduziert. Wenn die Gesellschaft in Anteile von OGAW (einschließlich anderer Teilfonds der Gesellschaft) und anderer zulässiger OGA investiert, die direkt oder indirekt von der Verwaltungsgesellschaft selbst oder von einer Gesellschaft verwaltet werden, die durch gemeinsame Führung oder Kontrolle oder über eine direkte oder indirekte Beteiligung von mehr als 10 % am Kapital oder der Stimmrechte verbunden ist, tritt keine doppelte Berechnung von Management-, Zeichnungs- oder Rückkaufgebühren zwischen der Gesellschaft und den OGA ein, in die die Gesellschaft investiert.

### c) Vergütungen, Spesen und Interessen der Verwaltungsratsmitglieder

Ein Verwaltungsratsmitglied kann an jeder Transaktion oder jeder Vereinbarung mit der Gesellschaft oder an der die Gesellschaft ein Interesse besitzt, als Partei beteiligt oder in anderer Weise ein Interesse besitzen, vorausgesetzt, dass er den anderen Verwaltungsratsmitgliedern vor Abschluss einer solchen Transaktion oder Vereinbarung die Art und den Umfang eines wesentlichen Interesses daran offengelegt hat. Vorbehaltlich der Zustimmung des Verwaltungsrats ist ein Verwaltungsratsmitglied berechtigt, in Bezug auf einen Vertrag oder eine Vereinbarung oder ein Angebot jeglicher Art, an dem/der er beteiligt ist, seine Stimme abzugeben, nachdem er den Verwaltungsrat über seine Beteiligung in Kenntnis gesetzt hat. Sein Amt hindert ihn nicht daran, Verträge mit der Gesellschaft zu schließen. Falls ein Verwaltungsratsmitglied sein Interesse an einem Vertrag bekundet, den die Gesellschaft einzugehen erwägt, darf seine Stimme bezüglich des Quorums bei Versammlungen zur Beratung über den Vertrag gezählt werden und das Mitglied darf an allen Abstimmungen zur Beschlussfassung hinsichtlich des Abschlusses eines solchen Vertrags teilnehmen, vorausgesetzt, dass sich die Entscheidung des Verwaltungsrats auf laufende Geschäftstransaktionen bezieht, die unter normalen Bedingungen erfolgen.

Die Gesellschaft zahlt jedem der unabhängigen und nicht geschäftsführenden Verwaltungsratsmitglieder eine jährliche Vergütung von 55.000 EUR. Dieser Betrag wird von der Verwaltungsgesellschaft aus den Betriebs-, Verwaltungs- und Dienstleistungskosten beglichen. Der Betrag der Betriebs-, Verwaltungs- und Dienstleistungskosten wird bei jeder Berechnung des Nettoinventarwerts abgegrenzt und vierteljährlich nachträglich gezahlt. Zum Ende des Geschäftsjahres am 31. März 2024 wurden insgesamt 165.000 EUR als Bezüge für unabhängige und nicht geschäftsführende Verwaltungsratsmitglieder berechnet.

# Erläuterungen zum Abschluss

## für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

### 4. Gebühren und Kosten (Fortsetzung)

#### d) Betriebskosten, Verwaltungs- und Kontoführungsgebühren/Gebühren für die Währungsabsicherung der abgesicherten Anteilsklassen

Die Gesellschaft zahlt der Verwaltungsgesellschaft Gebühren zur Deckung bestimmter Betriebskosten, Verwaltungs- und Kontoführungsgebühren und für die Durchführung der Währungsabsicherung. Die Verwaltungsgesellschaft ist dafür zuständig, aus dieser Gebühr die unten beschriebenen Kosten zu decken, die u. a. an die Depotbank, die Verwaltungsstelle sowie die Register- und Transferstelle oder ein anderes beauftragtes Unternehmen zu entrichten sind. Wenn die Summe der nachstehend beschriebenen tatsächlich angefallenen Aufwendungen höher ist als die Summe der Betriebs-, Verwaltungs- und Dienstleistungskosten und der für die einzelnen

Teilfonds und Anteilsklassen festgesetzten Gebühr für die Währungsabsicherung, werden die Kosten, die über diesen jährlichen Prozentsatz hinausgehen, direkt von der Verwaltungsgesellschaft oder ihren verbundenen Unternehmen getragen. Ebenso können eventuelle Überschüsse von der Verwaltungsgesellschaft oder ihren verbundenen Unternehmen einbehalten werden.

- (i) Die Betriebs-, Verwaltungs- und Dienstleistungskosten umfassen die laufenden Depotbank- und Verwahrungsgebühren, die an die Depotbank und ihre Korrespondenzbanken zu zahlen sind, Gebühren für Buchhaltungs- und Verwaltungsdienstleistungen des Fonds (einschließlich Domizilstellendienstleistungen), die an die Verwaltungsstelle zu zahlen sind, und Transferstellengebühren für Register- und Transferstellendienstleistungen, die an die Register- und Transferstelle zu zahlen sind.

Die Betriebs-, Verwaltungs- und Dienstleistungskosten decken auch die Aufwendungen ab, die mit der Auflegung neuer Teilfonds verbunden sind; die Kosten der Tochtergesellschaften (siehe Absatz (6) unten); die Luxemburger Taxe d'Abonnement, die auf die Vermögenswerte zu dem Satz erhoben wird, der im Prospekt der Gesellschaft unter der Überschrift „Besteuerung“ angegeben ist; die Vergütungen und angemessenen Auslagen der Mitglieder des Verwaltungsrats; Rechtskosten und Prüfungsgebühren; die laufenden Registrierungs- und Notierungsgebühren, einschließlich Übersetzungskosten; die Kosten und Gebühren für die Erstellung, den Druck und den Vertrieb des Prospekts der Gesellschaft, der wesentlichen Anlegerinformationen, der Jahres- und Halbjahresberichte, der Bilanzen und sonstigen Dokumente, die den Anteilhabern direkt oder über Vermittler zur Verfügung gestellt werden.

Die Gebühr für jeden Teilfonds bzw. jede Klasse errechnet sich aus einem festen Prozentsatz des Nettoinventarwerts des jeweiligen Teilfonds oder der jeweiligen Klasse, der im Prospekt der Gesellschaft vom Januar 2024 angegeben ist (wie aus der Tabelle auf Seite 72 ff. hervorgeht). Diese Gebühr läuft täglich auf und ist monatlich nachträglich zahlbar.

Für die Anteile der Klasse W fallen keine Betriebskosten, Verwaltungs- und Kontoführungsgebühren an. Sämtliche Gebühren und Kosten dieser Anteilsklasse werden direkt von einem Mitglied oder verbundenen Unternehmen der HSBC-Gruppe übernommen.

- (ii) Die Gebühren für die Währungsabsicherung beinhalten die Gebühren der Verwaltungsstelle oder anderer beauftragter Parteien für die Währungsabsicherung der gegenüber einer Währung abgesicherten Anteilsklassen und der Währungsoverlay-Anteilsklassen, die unter „Profil der typischen Anlegerkategorien“ beschrieben sind.

Der Höchstsatz der unter (i) und (ii) genannten Gebühren für Anteile der Klassen A, B, E, I, J, L, M, N, P, R, S, X, Y, YP, Z und ZP beträgt zusammengenommen jeweils 1,0 %. Der Verwaltungsrat behält sich jedoch das Recht vor, die Höhe der oben angegebenen Gebühren für die einzelnen Anteilsklassen zu ändern. Sollten diese Kosten und Gebühren angehoben werden, wird dies den betreffenden Anteilhabern mindestens einen Monat vor der Erhöhung mitgeteilt. Während dieses Zeitraums können die Anteilhaber kostenlos die Rücknahme ihrer Anteile beantragen.

Die Verwaltungsgesellschaft kann die Gesellschaft anweisen, einen Teil der erwähnten Gebühren direkt aus ihrem Vermögen an die oben aufgeführten Dienstleistungsanbieter zu zahlen. In diesem Fall wird die der Verwaltungsgesellschaft bezahlte Gebühr entsprechend gesenkt.

# Erläuterungen zum Abschluss

für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## 4. Gebühren und Kosten (Fortsetzung)

d) Betriebskosten, Verwaltungs- und Kontoführungsgebühren/Gebühren für die Währungsabsicherung (Fortsetzung)

Die folgende Tabelle gibt die Ausgaben für Betriebs-, Verwaltungs- und Dienstleistungskosten in Prozent an:

|   | Klasse A, B, E,<br>M, N, P, R, U | Klasse F, I, J, K, L,<br>S, T, Y, Z <sup>+</sup> , ZP | Klasse X, SP<br>(max. %) | Klasse W |
|---|----------------------------------|---|--------------------------|----------|
| <b>AKTIENTEILFONDS</b>                          |                                  |   |                          |          |
| a) Aktienteilfonds                              |                                  |   |                          |          |
| ASEAN Equity                                    | 0,35                             | 0,25  | 0,20                     | 0,00     |
| Asia ex Japan Equity                            | 0,35                             | 0,25  | 0,20                     | 0,00     |
| Asia ex Japan Equity Smaller Companies          | 0,35                             | 0,25  | 0,20                     | 0,00     |
| Asia Pacific ex Japan Equity High Dividend      | 0,35                             | 0,25*   | 0,20                     | 0,00     |
| China A-Shares Equity                           | 0,40                             | 0,30 <sup>l</sup>                                     | 0,20                     | 0,00     |
| Chinese Equity                                  | 0,40                             | 0,30 <sup>l</sup>                                     | 0,20                     | 0,00     |
| Euroland Equity Smaller Companies               | 0,35                             | 0,25 <sup>x</sup>                                     | 0,20                     | 0,00     |
| Euroland Growth                                 | 0,35                             | 0,25  | 0,20                     | 0,00     |
| Euroland Value                                  | 0,35                             | 0,25  | 0,20                     | 0,00     |
| Europe Value                                    | 0,35                             | 0,25  | 0,20                     | 0,00     |
| Global Emerging Markets Equity                  | 0,40 <sup>^^</sup>               | 0,30 <sup>xx</sup>                                    | 0,20                     | 0,00     |
| Global Equity Circular Economy                  | 0,35                             | 0,25  | 0,20                     | 0,00     |
| Global Equity Climate Change                    | 0,35                             | 0,25 <sup>ll</sup>                                    | 0,20                     | 0,00     |
| Global Equity Sustainable Healthcare            | 0,35                             | 0,25 <sup>**</sup>                                    | 0,20                     | 0,00     |
| Global Infrastructure Equity                    | 0,35                             | 0,25 <sup>lll</sup>                                   | 0,20                     | 0,00     |
| Global Real Estate Equity                       | 0,40                             | 0,25 <sup>^^^</sup>                                   | 0,20                     | 0,00     |
| Global Lower Carbon Equity                      | 0,35                             | 0,25  | 0,20                     | 0,00     |
| Global Sustainable Equity Income                | 0,35                             | 0,25  | 0,20                     | 0,00     |
| Global Sustainable Long Term Dividend           | 0,35                             | 0,25  | 0,20                     | 0,00     |
| Global Sustainable Long Term Equity             | 0,35                             | 0,20 <sup>+</sup>                                     | 0,20                     | 0,00     |
| Hong Kong Equity                                | 0,35                             | 0,25  | 0,20                     | 0,00     |
| b) Internationale und regionale Aktienteilfonds |                                  |   |                          |          |
| BRIC Equity                                     | 0,35                             | 0,25  | 0,20                     | 0,00     |
| BRIC Markets Equity                             | 0,35                             | 0,25  | 0,20                     | 0,00     |
| Frontier Markets                                | 0,50                             | 0,40 <sup>***</sup>                                   | 0,30                     | 0,00     |
| Global Equity Volatility Focused                | 0,35                             | 0,25  | 0,20                     | 0,00     |
| c) Marktspezifische Aktienteilfonds             |                                  |   |                          |          |
| Brazil Equity                                   | 0,40                             | 0,30 <sup>^</sup>                                     | 0,20                     | 0,00     |
| Economic Scale US Equity                        | 0,35                             | 0,25 <sup>lll</sup>                                   | 0,20                     | 0,00     |
| Indian Equity                                   | 0,40                             | 0,30 <sup>^</sup>                                     | 0,20                     | 0,00     |
| Mexico Equity (geschlossen zum 28. Juli 2023)   | 0,40                             | 0,30  | 0,25                     | 0,00     |
| Russia Equity <sup>#</sup>                      | 0,40                             | 0,30 <sup>***</sup>                                   | 0,20                     | 0,00     |
| Turkey Equity                                   | 0,40                             | 0,30  | 0,20                     | 0,00     |

+ Bis zum 31. Juli 2023 lautete der Name des Teilfonds „Thai Equity“

\* 0,30 % für Anteilsklasse S9, 0,25 % für Anteilsklasse S45, 0,35 % für Anteilsklasse S48

\*\* 0,20 % für die Anteilsklassen S39 und J

\*\*\* 0,40 % für Anteilsklasse S36.

\*\*\*\* 0,30 % für Anteilsklasse S7

x 0,20 % für Anteilsklasse S33

xx 0,20 % für Anteilsklasse F, 0,25 % für Anteilsklasse L

^^^ 0,20 % für Anteilsklasse Z

^^ 0,35 % für Anteilsklasse M

^ 0,40 % für Anteilsklasse J

+ 0,20 % für die Anteilsklassen T und T-Anteile stehen für Anlagen zur Verfügung, bis das verwaltete Vermögen des Teilfonds einen Schwellenwert von 150 Millionen USD erreicht

~ Die angegebenen Sätze stellen den Höchstsatz in % für die Anteilsklassen F, K und Z dar

<sup>l</sup> 0,20 % für Anteilsklasse S34

<sup>ll</sup> 0,20 % für Anteilsklasse J, 0,20 % für die Anteilsklassen S und S41.

<sup>lll</sup> 0,20 % für Anteilsklasse S42

<sup>llll</sup> 0,25 % für die Anteilsklassen J und S46.

<sup>#</sup> 0,20 % für Anteilsklasse S43

<sup>^</sup> Nach der Aussetzung der Berechnung des Nettoinventarwerts des Teilfonds zum 25. Februar 2022 wurden bis zum 31. März 2024 keine Betriebskosten, Verwaltungs- und Kontoführungsgebühren abgegrenzt.

# Erläuterungen zum Abschluss

für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## 4. Gebühren und Kosten (Fortsetzung)

### d) Betriebskosten, Verwaltungs- und Kontoführungsgebühren/Gebühren für die Währungsabsicherung (Fortsetzung)

| Teilfonds   | Klasse A,<br>B, E,<br>M, N, P, R,<br>U | Klasse F, I,<br>J, K, L, S,<br>T, Y, Z <sup>~</sup> ,<br>ZP | Klasse X,<br>SP<br>(max. %) | Klasse<br>W |
|---|--|---|-----------------------------|-------------|
| <b>RENTEITEILFONDS</b>  |  |   |                             |             |
| Asia Bond   | 0,35                                   | 0,25 <sup>+</sup>   | 0,20                        | 0,00        |
| Asia ESG Bond   | 0,35                                   | 0,25  | 0,20                        | 0,00        |
| Asia High Yield Bond  | 0,35                                   | 0,25 <sup>+++</sup>   | 0,20                        | 0,00        |
| Asian Currencies Bond   | 0,35                                   | 0,25  | 0,20                        | 0,00        |
| Brazil Bond   | 0,35                                   | 0,25  | 0,20                        | 0,00        |
| Corporate Euro Bond Fixed Term 2027 (aufgelegt zum 30. Juni 2023) <sup>ww</sup> | 0,20                                   | 0,20  | 0,20                        | 0,00        |
| Euro Bond   | 0,25                                   | 0,15  | 0,15                        | 0,00        |
| Euro Bond Total Return  | 0,25                                   | 0,20 <sup>^</sup>   | 0,15                        | 0,00        |
| Euro Credit Bond  | 0,25                                   | 0,20 <sup>^</sup>   | 0,15                        | 0,00        |
| Euro High Yield Bond  | 0,25                                   | 0,20 <sup>^</sup>   | 0,15                        | 0,00        |
| ESG Short Duration Credit Bond  | 0,25                                   | 0,15  | 0,15                        | 0,00        |
| GEM Debt Total Return   | 0,35                                   | 0,25 <sup>##</sup>  | 0,25                        | 0,00        |
| Global Bond   | 0,25                                   | 0,15  | 0,15                        | 0,00        |
| Global Bond Total Return  | 0,25                                   | 0,20 <sup>^</sup>   | 0,15                        | 0,00        |
| Global Corporate Bond   | 0,25                                   | 0,20 <sup>^</sup>   | 0,15                        | -           |
| Global Emerging Markets Bond  | 0,35                                   | 0,25 <sup>#</sup>   | 0,20                        | 0,00        |
| Global Emerging Markets Corporate Sustainable Bond                              | 0,35                                   | 0,25  | 0,20                        | 0,00        |
| Global Emerging Markets ESG Bond  | 0,35                                   | 0,25  | 0,20                        | 0,00        |
| Global Emerging Markets ESG Local Debt  | 0,35                                   | 0,25 <sup>###</sup>   | 0,20                        | -           |
| Global Emerging Markets Local Debt  | 0,35                                   | 0,25  | 0,20                        | 0,00        |
| Global ESG Corporate Bond   | 0,25                                   | 0,20  | 0,15                        | 0,00        |
| Global Government Bond  | 0,25                                   | 0,20  | 0,15                        | -           |
| Global Green Bond   | 0,25                                   | 0,20  | 0,15                        | 0,00        |
| Global High Income Bond   | 0,25                                   | 0,20 <sup>^</sup>   | 0,15                        | 0,00        |
| Global High Yield Bond  | 0,25                                   | 0,20  | 0,15                        | 0,00        |
| Global High Yield ESG Bond  | 0,25                                   | 0,20  | 0,15                        | 0,00        |
| Global High Yield Securitised Credit Bond                                       | 0,25                                   | 0,20  | 0,15                        | -           |
| Global Inflation Linked Bond  | 0,25 <sup>^^</sup>                     | 0,20 <sup>+++</sup>   | 0,15                        | 0,00        |
| Global Investment Grade Securitised Credit Bond                                 | 0,25                                   | 0,20  | 0,15                        | 0,00        |
| Global Lower Carbon Bond  | 0,25                                   | 0,20  | 0,15                        | 0,00        |
| Global Securitised Credit Bond  | 0,25                                   | 0,20  | 0,15                        | 0,00        |
| Global Short Duration Bond  | 0,20                                   | 0,15 <sup>-</sup>   | 0,11                        | 0,00        |
| India Fixed Income  | 0,35                                   | 0,25  | 0,20                        | 0,00        |
| RMB Fixed Income  | 0,25                                   | 0,20  | 0,15                        | 0,00        |
| Singapore Dollar Income Bond  | 0,20                                   | 0,10 <sup>^^</sup>  | 0,20                        | 0,00        |
| Ultra Short Duration Bond   | 0,15                                   | 0,15  | 0,15                        | 0,00        |
| US Dollar Bond  | 0,25                                   | 0,15  | 0,15                        | 0,00        |
| US High Yield Bond  | 0,25                                   | 0,15 <sup>^^</sup>  | 0,15                        | 0,00        |
| US Short Duration High Yield Bond   | 0,25                                   | 0,20 <sup>^</sup>   | 0,15                        | 0,00        |

\* Bis zum 2. Juli 2023 lautete der Name des Teilfonds „Global Short Duration High Yield Bond“

<sup>^</sup> 0,15 % für Anteilsklasse S

<sup>^^</sup> 0,20 % für Anteilsklasse F & Z

<sup>^^^</sup> 0,12 % für Anteilsklasse P

<sup>+</sup> 0,20 % für Anteilsklasse S26; 0,35 % für Anteilsklasse S47

<sup>+++</sup> 0,12 % für Anteilsklasse S26, 0,15 % für die Anteilsklassen Z und F

<sup>++++</sup> 0,20 % für die Anteilsklassen S28 und S40

<sup>~</sup> Die angegebenen Sätze stellen den Höchstsatz in % für die Anteilsklassen F, K und Z dar

<sup>~</sup> 0,11 % für Anteilsklasse S16, 0,18 % für Anteilsklasse I

<sup>#</sup> 0,10 % für Anteilsklasse S6, 0,20 % für Anteilsklasse S20

<sup>##</sup> 0,30 % für Anteilsklasse I, 0,20 % für Anteilsklasse S21, 0,25 % für Anteilsklasse S4

<sup>###</sup> 0,20 % für die Anteilsklassen F und S11

# Erläuterungen zum Abschluss

## für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

### 4. Gebühren und Kosten (Fortsetzung)

#### d) Betriebskosten, Verwaltungs- und Kontoführungsgebühren/Gebühren für die Währungsabsicherung (Fortsetzung)

| Teilfonds  | Klasse A, B, E,<br>M, N, P, R, U | Klasse F, I, J, K, L,<br>S, T, Y, Z <sup>---</sup> , ZP | Klasse X, SP<br>(max. %) | Klasse W |
|--|----------------------------------|---|--------------------------|----------|
| <b>SONSTIGE TEILFONDS</b>  |                                  |   |                          |          |
| Global Credit Floating Rate Fixed Term Bond 2023 – 1 (geschlossen zum 5. Juli 2023)                    | 0,13                             | 0,13 <sup>+</sup>                                       | -                        | -        |
| Global Credit Floating Rate Fixed Term Bond 2023 – 2 (geschlossen zum 29. Dezember 2023) <sup>ww</sup> | 0,13                             | 0,13 <sup>+</sup>                                       | -                        | -        |
| Global Emerging Markets Multi-Asset Income   | 0,35                             | 0,25 <sup>+</sup>                                       | 0,20                     | 0,00     |
| Managed Solutions – Asia Focused Conservative  | 0,35                             | 0,25  | 0,20                     | 0,00     |
| Managed Solutions – Asia Focused Growth  | 0,35                             | 0,25  | 0,20                     | 0,00     |
| Managed Solutions – Asia Focused Income  | 0,35                             | 0,25 <sup>**</sup>                                      | 0,20                     | 0,00     |
| Multi-Asset Style Factors  | 0,20                             | 0,20 <sup>---</sup>                                     | 0,15                     | 0,00     |
| Multi-Strategy Target Return   | 0,20                             | 0,20 <sup>^*</sup>                                      | 0,15                     | 0,00     |
| US Income Focused  | 0,25                             | 0,15 <sup>+</sup>                                       | 0,15                     | 0,00     |

+\* 0,20 % für Anteilsklasse F

^+ 0,20 % für Anteilsklasse und 0,15 % für Anteilsklasse ZP

~ Die angegebenen Sätze stellen den Höchstsatz in % für die Anteilsklassen F, K und Z dar

--- 0,15 % für die Anteilsklassen F, K und Z

^\*\* 0,35 % für Anteilsklasse S49 und 0,15 % für die Anteilsklassen F und Z

<sup>ww</sup> Bei diesem Prozentsatz handelt es sich um eine gedeckelte Gebühr. Der tatsächlich gezahlte Betrag hängt von den tatsächlichen Betriebskosten, Verwaltungs- und Kontoführungsgebühren ab, die einer Anteilsklasse entstehen. Alle einer Anteilsklasse tatsächlich entstehenden Betriebs-, Verwaltungs- und Dienstleistungskosten, die diese Obergrenze überschreiten, gehen zulasten der Verwaltungsgesellschaft.

### 5. Transaktionskosten und Sonderausgaben

Die mit dem Wertpapierhandel verbundenen Transaktionskosten sind in den Kosten für gekaufte Anlagen enthalten, werden von den Erlösen aus dem Verkauf von Anlagen abgezogen und sind in der Aufwands- und Ertragsrechnung und den Veränderungen des Nettovermögens unter der Überschrift „Transaktionskosten“ aufgeführt.

Jeder Teilfonds trägt die Kosten und Aufwendungen für den Kauf und Verkauf von Portfoliowertpapieren und Finanzinstrumenten, Maklergebühren und -provisionen, fälligen Zinsen oder Steuern sowie sonstige transaktionsbedingte Ausgaben. Die Transaktionskosten werden als Bargeld verbucht und bei Fälligkeit aus dem Nettovermögen des Teilfonds, dem sie zuzurechnen sind, bezahlt oder diesem in Rechnung gestellt. Die Transaktionskosten werden den Anteilsklassen der einzelnen Teilfonds zugewiesen.

Die Gesellschaft übernimmt die Sonderausgaben, darunter jegliche Prozesskosten, die gesamten Steuern, Abgaben, Zölle oder ähnliche Gebühren und jegliche unerwarteten Gebühren, die ihr oder ihren Vermögenswerten auferlegt werden.

Bei Schuldtiteln und Derivaten sind die Transaktionskosten nicht als Einzelposten neben dem Kaufpreis des Wertpapiers identifizierbar und können daher nicht getrennt ausgewiesen werden.

# Erläuterungen zum Abschluss

## für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

### 6. Besteuerung der Gesellschaft

Folgendes basiert auf dem Verständnis der Gesellschaft der derzeit im Großherzogtum Luxemburg anwendbaren Gesetze und gängigen Praxis und unterliegt Änderungen daran.

Die Gesellschaft unterliegt keiner luxemburgischen Gewinn- oder Ertragsteuer. Die Gesellschaft hat in Luxemburg jedoch eine jährliche Steuer von 0,05 % ihres Nettoinventarwerts zu entrichten, die vierteljährlich auf Grundlage des Wertes des Nettovermögens der Gesellschaft am Ende des relevanten Kalenderquartals zu zahlen ist. Der jährliche Steuersatz wurde für die Klassen SP, ZP, J, L, S, W, X und Z der jeweiligen Teilfonds auf 0,01 % reduziert. Bei der Ausgabe von Anteilen ist in Luxemburg keine Stempel- oder andere Steuer zu entrichten.

Die Klassen oder die Teilfonds können von dieser Steuer in Höhe von 0,01 % befreit werden, wenn sie die folgenden Voraussetzungen gemäß Artikel 174 und 175 des Gesetzes von 2010 erfüllen: (i) die Anteile der Klasse oder des Teilfonds dürfen nur institutionellen Anlegern vorbehalten sein; (ii) der ausschließliche Zweck des Portfolios der Klasse oder des Teilfonds muss die Anlage in Geldmarktinstrumenten bzw. Einlagen bei Kreditinstituten sein; (iii) die durchschnittliche Restlaufzeit des Portfolios der Klasse oder des Teilfonds muss weniger als 90 Tage betragen; (iv) die Klasse oder der Teilfonds müssen das höchstmögliche Rating einer anerkannten Rating-Agentur besitzen.

Folgende sind ebenfalls von dieser Steuer befreit:

- a) alle Teilfonds, die ausschließlich von Pensionsfonds und gleichgestellten Organismen gehalten werden;
- b) Teilfonds, deren Hauptziel darin besteht, in Mikrofinanzinstitute zu finanzieren;
- c) Teilfonds/Anteilsklassen, (i) deren Anteile an mindestens einer Börse oder einem anderen geregelten Markt notiert sind bzw. gehandelt werden, die regelmäßig geöffnet, anerkannt und der Öffentlichkeit zugänglich sind und (ii) deren ausschließliches Ziel darin besteht, die Performance eines oder mehrerer Indizes abzubilden. Wenn in dem betreffenden Teilfonds mehrere Anteilklassen ausgegeben wurden, die die vorstehend unter (ii) genannten Bedingungen erfüllen, gilt die Befreiung nur für die Anteilklassen, die die vorstehend unter (i) genannten Bedingungen erfüllen;
- d) (anteilig) der Teil des Vermögens eines Teilfonds, der in einen Luxemburger Anlagefonds oder einen von dessen Teilfonds investiert wird, soweit er der Zeichnungssteuer unterliegt;

Ferner sind von dieser Steuer die Vermögenswerte befreit, die durch Anteile an sonstigen zulässigen OGA repräsentiert werden, sofern derlei Anteile bereits dieser Steuer gemäß Artikel 174 des Gesetzes von 2010 in der jeweils geltenden Fassung oder Artikel 68 des Gesetzes vom 13. Februar 2007 in der jeweils geltenden Fassung unterliegen.

Auf die realisierten und nicht realisierten Kapitalgewinne der Vermögenswerte der Gesellschaft ist keine luxemburgische Steuer zu entrichten.



# Erläuterungen zum Abschluss

## für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

### 6. Besteuerung der Gesellschaft (Fortsetzung)

#### *Sonstige Steuern*

Gemäß den geltenden Steuergesetzen in anderen Ländern wird eventuell eine Quellensteuer von Zinsen und Dividenden abgezogen. Weiterhin können Kapitalertragsteuern in unterschiedlicher Höhe anfallen. Eine Zusammenfassung der Steuergesetze und -praktiken in anderen Ländern finden Sie in Anhang I.

#### *Allgemeine Informationen*

Die Gesellschaft kann als ausländischer Investmentfonds in vielen Ländern im Hinblick auf die von ihr in diesen Märkten erzielten Anlagerenditen auf Anteilsbestände und Wertpapiere einer nicht erstattungsfähigen Steuer auf Gewinne und Erträge (entweder in Form einer Quellensteuer oder einer Direktveranlagung) unterliegen. Sofern praktikabel wird die Gesellschaft Rückerstattungen gemäß geltenden Doppelbesteuerungsabkommen und den Gesetzen der betreffenden Länder beantragen, um die Belastung durch lokale Steuern auf Anlagerenditen zu minimieren und für ihre Anteilhaber die bestmögliche Rendite zu erzielen. Derlei Anträge werden nach dem Verständnis der Gesellschaft bezüglich der Gültigkeit von solchen Ansprüchen basierend auf den Informationen erfolgen, die den Depotbanken, externen Beratern und anderen Quellen der Gesellschaft im Hinblick auf die Auslegung und Anwendung der jeweiligen Rechtsbestimmungen der Steuerbehörden in dem betreffenden Land zur Verfügung stehen.

Die Gesellschaft wird für Steuern auf Kapitalgewinne Rückstellungen bilden, sofern sie aufgrund der ihr zu dem betreffenden Datum zur Verfügung stehenden Informationen und Beratung der Ansicht ist, dass eine solche Steuer wahrscheinlich zahlbar ist. Etwaige gebildete Rückstellungen reichen unter Umständen aber nicht aus, um die letztlich fälligen Verbindlichkeiten zu decken, oder sie übersteigen derlei Verbindlichkeiten.

Die Gesellschaft beabsichtigt auf Basis der zu diesem Datum geltenden Steuergesetze und Steuerpraxis von Steuerbegünstigungen zu profitieren und ihrer Steuerpflicht nach bestem Bemühen nachzukommen. Änderungen am Steuerrecht oder an der Steuerpraxis in einem Land, in dem die Gesellschaft eingetragen ist, vermarktet wird oder investiert, könnten den Wert der Anlagen der Gesellschaft in dem betreffenden Land beeinflussen. Insbesondere in Fällen, in denen rückwirkende Änderungen am Steuerrecht oder der Steuerpraxis durch den Gesetzgeber oder die Steuerbehörden in einem bestimmten Land Anwendung finden, können bestehenden Anteilhabern in dem betreffenden Teilfonds Verluste entstehen. Die Gesellschaft gibt keine Gewährleistung hinsichtlich der steuerlichen Position von Renditen auf Anlagen in einem bestimmten Markt oder der Risiken rückwirkender steuerlicher Änderungen in einem bestimmten Markt oder Land ab.

### 7. Nettoinventarwert – Offenlegungen

#### a) Schlusskurse

Die Vermögenswerte der Teilfonds werden mit den Kursen bewertet, die zu verschiedenen Zeiten am 31. März 2024 zur Verfügung standen, bei dem es sich um den letzten Geschäftstag des Berichtszeitraums handelte.

Die folgenden Teilfonds werden mit den Kursen bewertet, die zu verschiedenen Zeiten vor dem 31. März 2024 zur Verfügung standen.

| <b>Teilfonds</b>                          | <b>Bewertungstag</b> |
|---|----------------------|
| Global High Yield Securitised Credit Bond | 25. März 2024        |
| Global Securitised Credit Bond            | 25. März 2024        |
| ASEAN Equity                              | 27. März 2024        |
| Asian Currencies Bond                     | 27. März 2024        |

\* Bis zum 31. Juli 2023 lautete der Name des Teilfonds „Thai Equity“.

Wenn die Gesellschaft die Nettoinventarwerte lediglich im Hinblick auf die Veröffentlichung berechnet hätte, wären als Marktwerte für die Bewertung des Nettovermögens die Schlusskurse per 31. März 2024 verwendet worden. Diese Nettoinventarwerte hätten sich jedoch nicht wesentlich von denjenigen unterschieden, die in diesem Abschluss angegeben werden.

# Erläuterungen zum Abschluss

## für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

### 7. Nettoinventarwert – Offenlegungen (Fortsetzung)

#### b) Überkreuzbeteiligungen zwischen Teilfonds

Zum 31. März 2024 belaufen sich die gegenseitigen Anlagen der Teilfonds auf insgesamt 399.298.082 USD, daher würde das konsolidierte Gesamt-Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres ohne gegenseitige Anlagen 32.854.217.949 USD betragen.

Die folgende Tabelle zeigt die von den jeweiligen Teilfonds eingegangenen Überkreuzbeteiligungen:

| Teilfonds                                     | Anlagewert<br>USD |
|---|-------------------|
| Global Bond                                   | 2.090.017         |
| Global Bond Total Return                      | 3.841.401         |
| Global Corporate Bond                         | 63.932.488        |
| Global Government Bond                        | 159.450.620       |
| Global High Yield Bond                        | 27.275.002        |
| Global High Yield ESG Bond                    | 922.548           |
| Ultra Short Duration Bond                     | 45.509.238        |
| US Dollar Bond                                | 6.462.463         |
| Global Emerging Markets Multi-Asset Income    | 3.079.536         |
| Managed Solutions – Asia Focused Conservative | 13.578.380        |
| Managed Solutions – Asia Focused Growth       | 5.916.915         |
| Managed Solutions – Asia Focused Income       | 22.835.757        |
| Multi-Strategy Target Return                  | 12.948.898        |
| US Income Focused                             | 31.454.819        |

### 8. Informationen zu Barsicherheiten

Zum 31. März 2024 hat die Gesellschaft folgende Barsicherheiten gezahlt/(erhalten):

| Teilfonds                     | Kontrahent                                     | Instrumententyp                                 | Währung | Barsicherheiten in<br>Teilfondswährung |
|-------------------------------|--|---|---------|--|
| <b>Asia Bond</b>              |  |   |         |  |
|                               | BNP Paribas, New York                          | Credit Default Swaps,<br>Devisenterminkontrakte | USD     | 80.000                                 |
| <b>Asia High Yield Bond</b>   |  |   |         |  |
|                               | Australia and New Zealand<br>Banking, Ballarat | Devisenterminkontrakte                          | USD     | (280.000)                              |
|                               | BNP Paribas, New York                          | Credit Default Swaps,<br>Devisenterminkontrakte | USD     | 233.329                                |
|                               | Credit Agricole                                | Devisenterminkontrakte                          | USD     | (430.000)                              |
|                               | State Street Bank and Trust<br>Company         | Devisenterminkontrakte                          | USD     | 310.000                                |
| <b>Euro Bond Total Return</b> |  |   |         |  |
|                               | HSBC Bank, London                              | Option, Futures                                 | EUR     | (850.000)                              |
|                               | Société Générale, Paris                        | Credit Default Swaps                            | EUR     | 910.882                                |
| <b>Euro Credit Bond</b>       |  |   |         |  |
|                               | HSBC Bank, London                              | Option, Futures                                 | EUR     | (1.200.000)                            |
|                               | Société Générale, Paris                        | Credit Default Swaps                            | EUR     | 1.978.155                              |
| <b>Euro High Yield Bond</b>   |  |   |         |  |
|                               | Société Générale, Paris                        | Devisenterminkontrakte                          | EUR     | 5.250                                  |

# Erläuterungen zum Abschluss

für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## 8. Informationen zu Barsicherheiten (Fortsetzung)

| Teilfonds                                     | Kontrahent                   | Instrumententyp                                       | Währung | Barsicherheiten in Teilfondswährung |
|---|------------------------------|---|---------|-------------------------------------|
| <b>GEM Debt Total Return</b>                  |                              |   |         |                                     |
|   | Barclays Bank, Plc           | Credit Default Swaps, Devisenterminkontrakte, Futures | USD     | 776.935                             |
|   | BNP Paribas, New York        | Devisenterminkontrakte                                | USD     | (160.000)                           |
|   | Citibank                     | Zinsswaps, Devisentermingeschäfte                     | USD     | 15.964                              |
|   | J.P Morgan, London           | Zinsswaps, Credit Default Swaps                       | USD     | 841.465                             |
|   | J.P Morgan, London           | Zinsswaps, Credit Default Swaps                       | USD     | (5.649)                             |
|   | J.P Morgan, London           | Zinsswaps, Credit Default Swaps                       | USD     | 17.159                              |
|   | Merrill Lynch International  | Devisenterminkontrakte                                | USD     | 1                                   |
|   | Morgan Stanley, London       | Devisenterminkontrakte                                | USD     | (50.000)                            |
|   | Standard Chartered Bank      | Devisenterminkontrakte                                | USD     | (90.000)                            |
|   | UBS                          | Devisenterminkontrakte                                | USD     | (161.952)                           |
| <b>Global Bond Total Return</b>               |                              |   |         |                                     |
|   | J.P Morgan, London           | Zinsswaps   | EUR     | (197.222)                           |
|   | J.P Morgan, London           | Zinsswaps   | USD     | 212.561                             |
| <b>Global Corporate Bond</b>                  |                              |   |         |                                     |
|   | Barclays Bank, Plc           | Credit Default Swaps                                  | USD     | (109.811)                           |
|   | Credit Agricole              | Devisenterminkontrakte                                | USD     | (6.691.559)                         |
|   | Merrill Lynch International  | Devisenterminkontrakte                                | USD     | (77.672)                            |
|   | Royal Bank of Canada, London | Devisenterminkontrakte                                | USD     | 1.345.473                           |
|   | Royal Bank of Canada, London | Devisenterminkontrakte                                | USD     | 370.000                             |
|   | Société Générale, Paris      | Devisenterminkontrakte                                | USD     | (17.514)                            |
| <b>Global Emerging Markets Bond</b>           |                              |   |         |                                     |
|   | Barclays Bank, Plc           | Credit Default Swaps, Futures                         | USD     | (409.359)                           |
|   | BNP Paribas, New York        | Devisenterminkontrakte                                | USD     | 110.000                             |
|   | Deutsche Bank, New York      | Devisenterminkontrakte                                | USD     | 2                                   |
|   | J.P Morgan, London           | Credit Default Swaps                                  | USD     | 301.581                             |
|   | Merrill Lynch International  | Devisenterminkontrakte                                | USD     | (980.000)                           |
|   | Morgan Stanley, London       | Optionen, Devisenterminkontrakte                      | USD     | 1.680.000                           |
|   | Standard Chartered Bank      | Devisenterminkontrakte                                | USD     | (970.000)                           |
| <b>Global Emerging Markets ESG Bond</b>       |                              |   |         |                                     |
|   | Barclays Bank, Plc           | Credit Default Swaps                                  | USD     | 118.102                             |
|   | J.P Morgan, London           | Credit Default Swaps, Futures                         | USD     | 126.587                             |
| <b>Global Emerging Markets ESG Local Debt</b> |                              |   |         |                                     |
|   | Barclays Bank, Plc           | Devisenterminkontrakte, Futures                       | USD     | 4.189.984                           |
|   | BNP Paribas, New York        | Devisenterminkontrakte, Optionen                      | USD     | 670.000                             |
|   | Citibank                     | Devisenterminkontrakte                                | USD     | 1.229                               |
|   | Goldman Sachs                | Devisenterminkontrakte                                | USD     | 120.000                             |
|   | HSBC Bank, London            | Devisenterminkontrakte                                | USD     | (990.000)                           |
|   | J.P Morgan, London           | Zinsswaps   | USD     | 318.469                             |
|   | J.P Morgan, London           | Zinsswaps   | USD     | 10.434                              |
|   | J.P Morgan, London           | Zinsswaps   | USD     | (155)                               |
|   | J.P Morgan, London           | Zinsswaps   | USD     | (45)                                |
|   | J.P Morgan, London           | Zinsswaps   | USD     | 58.581                              |
|   | Merrill Lynch International  | Devisenterminkontrakte, Optionen                      | USD     | (250.000)                           |
|   | Morgan Stanley, London       | Devisenterminkontrakte, Optionen                      | USD     | 929.928                             |
|   | Standard Chartered Bank      | Devisenterminkontrakte                                | USD     | 590.000                             |
|   | UBS                          | Devisenterminkontrakte, Optionen                      | USD     | (120.000)                           |

# Erläuterungen zum Abschluss

für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## 8. Informationen zu Barsicherheiten (Fortsetzung)

| Teilfonds                                 | Kontrahent                          | Instrumententyp                                       | Währung | Barsicherheiten in Teilfondswährung |
|---|-------------------------------------|---|---------|-------------------------------------|
| <b>Global Emerging Markets Local Debt</b> |                                     |   |         |                                     |
|   | Barclays Bank, Plc                  | Zinsswaps, Devisenterminkontrakte, Futures            | USD     | 13.411.601                          |
|   | Barclays Bank, Plc                  | Zinsswaps, Devisenterminkontrakte, Futures            | USD     | (804)                               |
|   | Barclays Bank, Plc                  | Zinsswaps, Devisenterminkontrakte, Futures            | USD     | (21)                                |
|   | BNP Paribas, New York               | Devisenterminkontrakte, Optionen                      | USD     | 178.906                             |
|   | Citibank                            | Devisenterminkontrakte                                | USD     | (5.905.743)                         |
|   | Credit Agricole                     | Devisenterminkontrakte                                | USD     | 360.000                             |
|   | Credit Suisse International, London | Zinsswaps   | USD     | 270.000                             |
|   | Deutsche Bank, New York             | Devisenterminkontrakte                                | USD     | 98.257                              |
|   | Goldman Sachs                       | Devisenterminkontrakte                                | USD     | 3.160.000                           |
|   | HSBC Bank, London                   | Devisenterminkontrakte                                | USD     | (2.225.878)                         |
|   | J.P Morgan, London                  | Zinsswaps   | USD     | (27)                                |
|   | J.P Morgan, London                  | Zinsswaps   | USD     | 1.951.868                           |
|   | J.P Morgan, London                  | Zinsswaps   | USD     | 32.978                              |
|   | J.P Morgan, London                  | Zinsswaps   | USD     | (660)                               |
|   | J.P Morgan, London                  | Zinsswaps   | USD     | (161)                               |
|   | J.P Morgan, London                  | Zinsswaps   | USD     | 210.909                             |
|   | Merrill Lynch International         | Devisenterminkontrakte, Optionen                      | USD     | (3.430.024)                         |
|   | Morgan Stanley, London              | Devisenterminkontrakte, Optionen                      | USD     | 5.050.000                           |
|   | Standard Chartered Bank             | Devisenterminkontrakte                                | USD     | (161)                               |
|   | Standard Chartered Bank             | Devisenterminkontrakte                                | USD     | 4.075.680                           |
| <b>Global ESG Corporate Bond</b>          |                                     |   |         |                                     |
|   | Credit Agricole                     | Devisenterminkontrakte                                | USD     | (460.000)                           |
|   | Merrill Lynch International         | Devisenterminkontrakte                                | USD     | (340.000)                           |
|   | Société Générale, Paris             | Devisenterminkontrakte                                | USD     | 430.000                             |
| <b>Global Government Bond</b>             |                                     |   |         |                                     |
|   | Barclays Bank, Plc                  | Devisenterminkontrakte                                | USD     | (880.000)                           |
|   | BNP Paribas, New York               | Devisenterminkontrakte                                | USD     | (10.000)                            |
|   | J.P Morgan, London                  | Zinsswaps   | USD     | 6.997.525                           |
|   | UBS                                 | Zinsswaps, Devisentermingeschäfte                     | USD     | 834.319                             |
| <b>Global High Income Bond</b>            |                                     |   |         |                                     |
|   | Barclays Bank, Plc                  | Credit Default Swaps, Devisenterminkontrakte, Futures | USD     | (1.988.148)                         |
|   | Barclays Bank, Plc                  | Credit Default Swaps, Devisenterminkontrakte, Futures | USD     | 1.683.711                           |
|   | BNP Paribas, New York               | Devisenterminkontrakte                                | USD     | 230.000                             |
|   | J.P Morgan, London                  | Credit Default Swaps, Futures                         | USD     | 6.527.335                           |
|   | Morgan Stanley, London              | Devisenterminkontrakte                                | USD     | (11.502)                            |
|   | Société Générale, Paris             | Devisenterminkontrakte                                | USD     | (54.000)                            |
| <b>Global High Yield Bond</b>             |                                     |   |         |                                     |
|   | BNP Paribas, New York               | Devisenterminkontrakte                                | USD     | (550.000)                           |
|   | Credit Agricole                     | Devisenterminkontrakte                                | USD     | 1.560.000                           |
|   | J.P Morgan, London                  | Futures, Credit Default Swaps                         | USD     | 901.382                             |
|   | Société Générale, Paris             | Devisenterminkontrakte                                | USD     | (16.325)                            |
|   | Standard Chartered Bank             | Devisenterminkontrakte                                | USD     | (30.000)                            |

# Erläuterungen zum Abschluss

für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## 8. Informationen zu Barsicherheiten (Fortsetzung)

| Teilfonds   | Kontrahent                          | Instrumententyp                              | Währung | Barsicherheiten in Teilfondswährung |
|---|-------------------------------------|--|---------|-------------------------------------|
| <b>Global High Yield ESG Bond</b>                 |                                     |  |         |                                     |
|   | Credit Agricole                     | Devisenterminkontrakte                       | USD     | (10.000)                            |
| <b>Global Inflation Linked Bond</b>               |                                     |  |         |                                     |
|   | Goldman Sachs                       | Zinsswaps, Devisentermingeschäfte            | USD     | 260.000                             |
|   | J.P Morgan, London                  | Zinsswaps                                    | USD     | 310.000                             |
| <b>Global Lower Carbon Bond</b>                   |                                     |  |         |                                     |
|   | Barclays Bank, Plc                  | Credit Default Swaps, Devisenterminkontrakte | USD     | (36.725)                            |
|   | J.P Morgan, London                  | Futures, Devisenterminkontrakte              | USD     | 20.000                              |
| <b>Global Short Duration Bond</b>                 |                                     |  |         |                                     |
|   | J.P Morgan, London                  | Zinsswaps                                    | USD     | 61.934                              |
| <b>RMB Fixed Income</b>                           |                                     |  |         |                                     |
|   | HSBC Bank, London                   | Devisenterminkontrakte                       | USD     | (1.200.000)                         |
|   | State Street Bank and Trust Company | Devisenterminkontrakte                       | USD     | 1.200.000                           |
| <b>Ultra Short Duration Bond</b>                  |                                     |  |         |                                     |
|   | BNP Paribas, New York               | Devisenterminkontrakte                       | USD     | 750.000                             |
|   | Standard Chartered Bank             | Devisenterminkontrakte                       | USD     | (760.000)                           |
| <b>US Dollar Bond</b>                             |                                     |  |         |                                     |
|   | Goldman Sachs                       | Devisenterminkontrakte                       | USD     | 1.523.000                           |
| <b>US High Yield Bond</b>                         |                                     |  |         |                                     |
|   | J.P Morgan, London                  | Futures, Credit Default Swaps                | USD     | 28.545                              |
| <b>Global Emerging Markets Multi-Asset Income</b> |                                     |  |         |                                     |
|   | Barclays Bank, Plc                  | Devisenterminkontrakte, Futures, Zinsswaps   | USD     | (42.505)                            |
|   | Barclays Bank, Plc                  | Devisenterminkontrakte, Futures, Zinsswaps   | USD     | (1.953)                             |
|   | Barclays Bank, Plc                  | Devisenterminkontrakte, Futures, Zinsswaps   | USD     | (8)                                 |
|   | Barclays Bank, Plc                  | Devisenterminkontrakte, Futures, Zinsswaps   | USD     | (28)                                |
|   | BNP Paribas, New York               | Devisenterminkontrakte, Optionen             | USD     | 100.000                             |
|   | Goldman Sachs                       | Devisenterminkontrakte                       | USD     | (10.000)                            |
|   | HSBC Bank, London                   | Devisenterminkontrakte, Futures              | USD     | (10.000)                            |
|   | J.P Morgan, London                  | Zinsswaps, Credit Default Swaps              | USD     | 25.802                              |
|   | J.P Morgan, London                  | Zinsswaps, Credit Default Swaps              | USD     | 741                                 |
|   | J.P Morgan, London                  | Zinsswaps, Credit Default Swaps              | USD     | (12)                                |
|   | J.P Morgan, London                  | Zinsswaps, Credit Default Swaps              | USD     | (3)                                 |
|   | J.P Morgan, London                  | Zinsswaps, Credit Default Swaps              | USD     | 4.063                               |
|   | Merrill Lynch International         | Devisenterminkontrakte, Optionen             | USD     | 10.000                              |
|   | Morgan Stanley, London              | Devisenterminkontrakte, Optionen             | USD     | (40.000)                            |
|   | Standard Chartered Bank             | Devisenterminkontrakte                       | USD     | 40.000                              |
|   | UBS                                 | Devisenterminkontrakte, Optionen             | USD     | 10.000                              |

# Erläuterungen zum Abschluss

für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## 8. Informationen zu Barsicherheiten (Fortsetzung)

| Teilfonds                           | Kontrahent                   | Instrumententyp  | Währung | Barsicherheiten in Teilfondswährung |
|-------------------------------------|------------------------------|--|---------|-------------------------------------|
| <b>Multi-Asset Style Factors</b>    |                              |  |         |                                     |
|                                     | Barclays Bank, Plc           | Devisenterminkontrakte   | EUR     | 108.924                             |
|                                     | BNP Paribas, New York        | Devisenterminkontrakte   | EUR     | 580.000                             |
|                                     | Credit Agricole              | Devisenterminkontrakte   | EUR     | (4.380.000)                         |
|                                     | HSBC Bank, London            | Devisenterminkontrakte, Futures, Zinsswaps, Overnight Index Swap           | EUR     | 10.578.689                          |
|                                     | HSBC Bank, London            | Devisenterminkontrakte, Futures, Zinsswaps, Overnight Index Swap           | EUR     | (1.113.401)                         |
|                                     | HSBC Bank, London            | Devisenterminkontrakte, Futures, Zinsswaps, Overnight Index Swap           | EUR     | 3.554.940                           |
|                                     | HSBC Bank, London            | Devisenterminkontrakte, Futures, Zinsswaps, Overnight Index Swap           | EUR     | 5.190.405                           |
|                                     | HSBC Bank, London            | Devisenterminkontrakte, Futures, Zinsswaps, Overnight Index Swap           | EUR     | (4)                                 |
|                                     | Merrill Lynch International  | Futures  | EUR     | (4.140.000)                         |
|                                     | Morgan Stanley, London       | Devisenterminkontrakte   | EUR     | 2.160.000                           |
|                                     | Royal Bank of Canada, London | Devisenterminkontrakte   | EUR     | 1.230.000                           |
|                                     | Société Générale, Paris      | Devisenterminkontrakte, Futures  | EUR     | 78.589                              |
|                                     | Standard Chartered Bank      | Devisenterminkontrakte   | EUR     | 1.140.000                           |
|                                     | UBS                          | Devisenterminkontrakte   | EUR     | (1.041.197)                         |
| <b>Multi-Strategy Target Return</b> |                              |  |         |                                     |
|                                     | Barclays Bank, Plc           | Devisenterminkontrakte   | EUR     | (1.964)                             |
|                                     | Citibank                     | Devisenterminkontrakte   | EUR     | 510.000                             |
|                                     | HSBC Bank, London            | Devisenterminkontrakte, Futures, Zinsswaps, Overnight Index Swap, Optionen | EUR     | (252.426)                           |
|                                     | HSBC Bank, London            | Devisenterminkontrakte, Futures, Zinsswaps, Overnight Index Swap, Optionen | EUR     | (4.851)                             |
|                                     | HSBC Bank, London            | Devisenterminkontrakte, Futures, Zinsswaps, Overnight Index Swap, Optionen | EUR     | (229.089)                           |
|                                     | HSBC Bank, London            | Devisenterminkontrakte, Futures, Zinsswaps, Overnight Index Swap, Optionen | EUR     | 255.790                             |
|                                     | HSBC Bank, London            | Devisenterminkontrakte, Futures, Zinsswaps, Overnight Index Swap, Optionen | EUR     | (184.821)                           |
|                                     | Merrill Lynch International  | Optionen   | EUR     | (80.000)                            |
|                                     | Morgan Stanley, London       | Devisenterminkontrakte   | EUR     | (180.000)                           |
|                                     | Société Générale, Paris      | Devisenterminkontrakte, Futures, Total Return Swap                         | EUR     | 233.500                             |
|                                     | Société Générale, Paris      | Devisenterminkontrakte   | EUR     | 1.266.709                           |
|                                     | UBS                          | Devisenterminkontrakte   | EUR     | 390.000                             |
| <b>US Income Focused</b>            |                              |  |         |                                     |
|                                     | Barclays Bank, Plc           | Futures, Credit Default Swaps  | USD     | (634.708)                           |
|                                     | J.P Morgan, London           | Credit Default Swaps   | USD     | (219.668)                           |

# Erläuterungen zum Abschluss

## für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

### 9. Dividenden

Die meisten ausschüttenden Anteilsklassen von Fonds, die zum 31. März 2024 in Umlauf waren, verfügten über den Status eines britischen „Reporting Fund“, entweder seit dem 1. April 2010 oder ab der Auflegung der entsprechenden Anteilsklasse des Fonds. Alle ausschüttenden und thesaurierenden Anteilsklassen verfügen seit dem 1. April 2013 über den Status eines britischen „Reporting Fund“. Bei Auflegung neuer Anteilsklassen von Fonds soll der Status eines britischen „Reporting Fund“ bei HM Revenue & Customs beantragt werden. Einzelheiten zu den Anteilsklassen, die über den Status eines britischen „Reporting Fund“ verfügen, stehen auf der Website von HM Revenue & Customs ([www.hmrc.gov.uk](http://www.hmrc.gov.uk)) zur Verfügung.

Zum Datum dieses Berichts finden Sie den Status unter <https://www.gov.uk/government/publications/offshore-funds-list-of-reporting-funds>

Die Gesellschaft veröffentlicht unter [www.kpmgreportingfunds.co.uk](http://www.kpmgreportingfunds.co.uk) jährliche Informationen zum berichtspflichtigen Einkommen, die Anteilhaber für ihre britischen Steuererklärungen benötigen. Anleger, die keinen Zugriff auf das Internet haben, können diese Informationen schriftlich beim Sitz der Gesellschaft beantragen.

Während des zum 31. März 2024 endenden Geschäftsjahres zahlte die Gesellschaft die folgenden Dividenden pro Anteil (Ex-Tag):

| Teilfonds   | Währung | Apr. 2023 | Mai 2023 | Jun. 2023 | Jul. 2023 | Aug. 2023 | Sep. 2023 | Okt. 2023 | Nov. 2023 | Dez. 2023 | Jan. 2024 | Feb. 2024 | Mär. 2024 |
|---|---------|-----------|----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| <b>ASEAN Equity</b>                               |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| AD  | USD     | -         | 0,281285 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| <b>Asia ex Japan Equity</b>                       |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| AD  | USD     | -         | 0,206235 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ADO EUR*  | USD     | -         | 0,058229 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| BD  | USD     | -         | 0,112429 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| BD GBP*   | USD     | -         | 0,228571 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ED  | USD     | -         | -        | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ID  | USD     | -         | 0,766829 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ZD  | USD     | -         | 1,241478 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| <b>Asia ex Japan Equity Smaller Companies</b>     |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| AD  | USD     | -         | 0,560363 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| AD HKD*   | USD     | -         | 0,018288 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| BD  | USD     | -         | 0,213807 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| BD GBP*   | USD     | -         | 0,499177 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ID  | USD     | -         | 0,395260 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| XD  | USD     | -         | 0,383720 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| <b>Asia Pacific ex Japan Equity High Dividend</b> |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| AM2   | USD     | 0,032428  | 0,032899 | 0,031003  | 0,029703  | 0,031802  | 0,028977  | 0,027883  | 0,027085  | 0,027586  | 0,026906  | 0,026084  | 0,027300  |
| AM2 HKD*  | USD     | 0,004171  | 0,004241 | 0,003987  | 0,003838  | 0,004065  | 0,003736  | 0,003591  | 0,003492  | 0,003546  | 0,003457  | 0,003350  | 0,003514  |
| AM30 RMB*   | USD     | 0,001178  | 0,001468 | 0,001438  | 0,000966  | 0,000861  | 0,001383  | 0,002423  | 0,001998  | 0,000809  | 0,000573  | 0,000926  | 0,000926  |
| AS  | USD     | -         | -        | -         | 0,252716  | -         | -         | -         | -         | -         | 0,086640  | -         | -         |
| BD EUR*   | USD     | -         | 0,324787 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| BS GBP*   | USD     | -         | -        | -         | 0,372831  | -         | -         | -         | -         | -         | 0,161097  | -         | -         |
| S48M2 SGD*  | USD     | -         | -        | -         | -         | 0,024567  | 0,023969  | 0,023922  | 0,023953  | 0,022744  | 0,022245  | 0,023442  | -         |
| S9S   | USD     | -         | -        | -         | 0,203660  | -         | -         | -         | -         | -         | 0,127327  | -         | -         |
| XD  | USD     | -         | 0,390532 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| XD EUR*   | USD     | -         | 0,378688 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| XM2   | USD     | 0,028783  | 0,029224 | 0,027563  | 0,026429  | 0,028322  | 0,025828  | 0,024870  | 0,024177  | 0,024646  | 0,024060  | 0,023343  | -         |
| ZM2   | USD     | 0,030540  | 0,031026 | 0,029279  | 0,028090  | 0,030120  | 0,027481  | 0,026478  | 0,025758  | 0,026269  | -         | -         | -         |
| ZS  | USD     | -         | -        | -         | 0,374447  | -         | -         | -         | -         | -         | 0,264822  | -         | -         |
| <b>China A-Shares Equity</b>                      |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| BD  | USD     | -         | 0,077096 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| <b>Chinese Equity</b>                             |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| AD  | USD     | -         | 0,971098 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| AD GBP*   | USD     | -         | 0,235113 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| AD HKD*   | USD     | -         | 0,015464 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| BD  | USD     | -         | 0,224215 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| BD GBP*   | USD     | -         | 0,393472 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ID  | USD     | -         | 1,866970 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ZD  | USD     | -         | 2,830066 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |

\* Die in der Erläuterung angegebenen Dividendensätze sind in der Währung des Teilfonds unter Verwendung des maßgeblichen Wechselkurses am Stichtag der jeweiligen Ausschüttung angegeben.

+ Bis zum 31. Juli 2023 lautete der Name des Teilfonds „Thai Equity“.

# Erläuterungen zum Abschluss

für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## 9. Dividenden (Fortsetzung)

| Teilfonds                                | Währung | Apr. 2023 | Mai 2023 | Jun. 2023 | Jul. 2023 | Aug. 2023 | Sep. 2023 | Okt. 2023 | Nov. 2023 | Dez. 2023 | Jan. 2024 | Feb. 2024 | Mär. 2024 |
|--|---------|-----------|----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| <b>Euroland Equity Smaller Companies</b> |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| AD                                       | EUR     | -         | 0,722011 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ID                                       | EUR     | -         | 0,252080 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| <b>Euroland Growth</b>                   |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| M1D                                      | EUR     | -         | 0,026812 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| <b>Euroland Value</b>                    |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| AD                                       | EUR     | -         | 0,653120 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ADH USD*                                 | EUR     | -         | 0,178420 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ID                                       | EUR     | -         | 0,440187 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ZD                                       | EUR     | -         | 1,433810 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| <b>Europe Value</b>                      |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| AD                                       | EUR     | -         | 0,788752 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ED                                       | EUR     | -         | 0,576735 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ID                                       | EUR     | -         | 0,257483 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| PD                                       | EUR     | -         | 0,970870 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ZD                                       | EUR     | -         | 1,489254 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| <b>Global Emerging Markets Equity</b>    |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| AD                                       | USD     | -         | 0,049353 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| AD GBP*                                  | USD     | -         | 0,050923 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| BD GBP*                                  | USD     | -         | 0,182384 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ED                                       | USD     | -         | -        | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| PD                                       | USD     | -         | 0,089651 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| S1D                                      | USD     | -         | 0,108325 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ZD                                       | USD     | -         | 0,337694 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| <b>Global Equity Climate Change</b>      |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| AD                                       | USD     | -         | -        | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| AD EUR*                                  | USD     | -         | -        | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ID GBP*                                  | USD     | -         | 0,014912 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ZQ1                                      | USD     | -         | -        | 0,065601  | -         | -         | 0,032973  | -         | -         | 0,029021  | -         | -         | 0,025915  |
| <b>Global Real Estate Equity</b>         |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| AD                                       | USD     | -         | 0,127221 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| AM2                                      | USD     | 0,024746  | 0,024973 | 0,024690  | 0,024699  | 0,025011  | 0,024877  | 0,024730  | 0,024096  | 0,024356  | 0,024698  | 0,024429  | 0,025039  |
| AM3O SGD*                                | USD     | 0,011917  | 0,010748 | 0,011175  | 0,011086  | 0,009828  | 0,009256  | 0,010084  | 0,010497  | 0,010049  | 0,009397  | 0,008670  | 0,009423  |
| BQ1                                      | USD     | -         | -        | 0,070392  | -         | -         | 0,094330  | -         | -         | 0,064621  | -         | -         | 0,086655  |
| ID                                       | USD     | -         | 0,214388 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ZBFIX8.5 JPY*                            | USD     | 0,826737  | -        | 0,781745  | -         | 0,822858  | -         | 0,757390  | -         | 0,815742  | -         | 0,795063  | -         |
| ZD                                       | USD     | -         | 0,302197 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ZM2                                      | USD     | 0,028150  | 0,028444 | 0,028166  | 0,028223  | 0,028620  | 0,028507  | 0,028381  | 0,027694  | 0,028035  | 0,028463  | 0,028202  | 0,028945  |
| ZQ1                                      | USD     | -         | -        | 0,060362  | -         | -         | 0,083794  | -         | -         | 0,057571  | -         | -         | 0,077402  |
| <b>Global Infrastructure Equity</b>      |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| AM2                                      | USD     | 0,032780  | 0,033103 | 0,032888  | 0,033567  | 0,034055  | 0,033610  | 0,032947  | 0,032516  | 0,032913  | 0,033401  | 0,033444  | 0,034630  |
| AM2 HKD*                                 | USD     | 0,004245  | 0,004296 | 0,004258  | 0,004367  | 0,004383  | 0,004363  | 0,004272  | 0,004221  | 0,004260  | 0,004320  | 0,004325  | 0,004488  |
| AM3O AUD*                                | USD     | 0,013104  | 0,012312 | 0,013896  | 0,016478  | 0,014740  | 0,013816  | 0,014049  | 0,014771  | 0,015583  | 0,015127  | 0,014664  | 0,015590  |
| AM3O EUR*                                | USD     | 0,013643  | 0,015034 | 0,016571  | 0,018407  | 0,019028  | 0,019220  | 0,021152  | 0,022198  | 0,019763  | 0,019427  | 0,021483  | 0,022693  |
| AM3O GBP*                                | USD     | 0,030273  | 0,032048 | 0,033133  | 0,039149  | 0,040024  | 0,038461  | 0,037696  | 0,038403  | 0,038148  | 0,038280  | 0,039050  | 0,040311  |
| AM3O RMB*                                | USD     | 0,000804  | 0,000967 | 0,001397  | 0,001019  | 0,000671  | 0,001728  | 0,003128  | 0,002654  | 0,001040  | 0,001020  | 0,001522  | 0,001574  |
| AMFLX                                    | USD     | 0,546947  | 0,514185 | 0,526049  | 0,563050  | 0,529606  | 0,513452  | 0,492454  | 0,536695  | 0,547810  | 0,523282  | 0,527942  | 0,538391  |
| AMFLX HKD*                               | USD     | 0,062727  | 0,058985 | 0,060334  | 0,064647  | 0,060702  | 0,058818  | 0,056465  | 0,061473  | 0,062817  | 0,059969  | 0,060506  | 0,061708  |
| AMFLXO AUD*                              | USD     | 0,231053  | 0,209238 | 0,226959  | 0,275235  | 0,235707  | 0,218604  | 0,211995  | 0,242802  | 0,263090  | 0,239723  | 0,234113  | 0,241797  |
| AMFLXO EUR*                              | USD     | 0,300632  | 0,295633 | 0,307450  | 0,364131  | 0,343137  | 0,327476  | 0,331606  | 0,379053  | 0,372619  | 0,343695  | 0,362000  | 0,369992  |
| AMFLXO GBP*                              | USD     | 0,493068  | 0,479221 | 0,501376  | 0,605554  | 0,567157  | 0,533837  | 0,510228  | 0,575842  | 0,583711  | 0,550980  | 0,562355  | 0,570311  |
| AMFLXO RMB*                              | USD     | 0,029155  | 0,029286 | 0,031612  | 0,031796  | 0,026405  | 0,034277  | 0,045934  | 0,045665  | 0,031494  | 0,029314  | 0,033643  | 0,033394  |
| BD                                       | USD     | -         | 0,020571 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ZBFIX8.5 JPY*                            | USD     | 1,026604  | -        | 0,962538  | -         | 1,023487  | -         | 0,947127  | -         | 1,042629  | -         | 0,967725  | -         |
| ZD                                       | USD     | -         | 0,246459 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ZQ1                                      | USD     | -         | -        | 0,146480  | -         | -         | 0,058201  | -         | -         | 0,069743  | -         | -         | 0,056004  |
| ZQ1 GBP*                                 | USD     | -         | -        | 0,188017  | -         | -         | 0,074716  | -         | -         | 0,089352  | -         | -         | 0,071883  |
| <b>Global Lower Carbon Equity</b>        |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| AD                                       | USD     | -         | 0,132229 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| AD HKD*                                  | USD     | -         | 0,016154 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ID                                       | USD     | -         | 0,213199 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ZQ1                                      | USD     | -         | -        | 0,099016  | -         | -         | 0,061169  | -         | -         | 0,066609  | -         | -         | 0,065666  |
| <b>Global Sustainable Equity Income</b>  |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| AD                                       | USD     | -         | 0,145800 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ZBFIX8.5 JPY*                            | USD     | 1,082899  | -        | 1,047731  | -         | 1,124264  | -         | 1,069875  | -         | 1,149872  | -         | 1,137414  | -         |
| ZM1                                      | USD     | 0,016627  | 0,040639 | 0,038315  | 0,017907  | 0,024992  | 0,019465  | 0,021211  | 0,022451  | 0,016398  | 0,018377  | 0,016997  | 0,041456  |
| ZQ1                                      | USD     | -         | -        | 0,080545  | -         | -         | 0,052249  | -         | -         | 0,051142  | -         | -         | 0,063099  |

\* Die in der Erläuterung angegebenen Dividendensätze sind in der Währung des Teilfonds unter Verwendung des maßgeblichen Wechselkurses am Stichtag der jeweiligen Ausschüttung angegeben.



# Erläuterungen zum Abschluss

für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## 9. Dividenden (Fortsetzung)

| Teilfonds                                    | Währung | Apr. 2023 | Mai 2023 | Jun. 2023 | Jul. 2023 | Aug. 2023 | Sep. 2023 | Okt. 2023 | Nov. 2023 | Dez. 2023 | Jan. 2024 | Feb. 2024 | Mär. 2024 |
|--|---------|-----------|----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| <b>Global Sustainable Long Term Dividend</b> |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| AM2  | USD     | 0,025069  | 0,021842 | 0,021506  | 0,022707  | 0,022866  | 0,022709  | 0,022538  | 0,021713  | 0,022567  | 0,022750  | 0,022584  | 0,022788  |
| AM2 HKD*                                     | USD     | 0,003234  | 0,002823 | 0,002773  | 0,002943  | 0,002931  | 0,002936  | 0,002911  | 0,002808  | 0,002910  | 0,002933  | 0,002909  | 0,002941  |
| AQ2  | USD     | 0,569800  | 0,569193 | 0,576380  | 0,614460  | 0,584490  | 0,562542  | 0,549398  | 0,605916  | 0,624822  | 0,649203  | 0,672481  | 0,675814  |
| EQ2  | USD     | -         | -        | 0,065359  | -         | -         | 0,067966  | -         | -         | 0,067587  | -         | -         | 0,067251  |
| ZM2  | USD     | -         | -        | 0,061972  | -         | -         | 0,065369  | -         | -         | 0,064868  | -         | -         | 0,065408  |
| IQ   | USD     | -         | -        | 0,029869  | -         | -         | 0,008281  | -         | -         | 0,018518  | -         | -         | 0,015633  |
| ZM2  | USD     | 0,025498  | 0,022244 | 0,021932  | 0,023187  | 0,023381  | 0,023251  | 0,023106  | 0,022293  | 0,023199  | 0,023416  | 0,023281  | 0,023522  |
| <b>Global Sustainable Long Term Equity</b>   |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| AD   | USD     | -         | -        | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| BD   | USD     | -         | 0,004080 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ID   | USD     | -         | 0,009500 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ZQ1  | USD     | -         | -        | -         | -         | -         | -         | -         | -         | 0,008369  | -         | -         | 0,026761  |
| <b>Hong Kong Equity</b>                      |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| AD   | USD     | -         | 0,979294 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| AD HKD*                                      | USD     | -         | 0,011296 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| BD GBP*                                      | USD     | -         | 0,258686 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| PD   | USD     | -         | 1,528724 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ZD   | USD     | -         | 2,993183 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| <b>BRIC Equity</b>                           |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| AD   | USD     | -         | 0,445788 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| AD GBP*                                      | USD     | -         | 0,453019 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| BD GBP*                                      | USD     | -         | 0,484376 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| M2D  | USD     | -         | 0,551272 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| <b>BRIC Markets Equity</b>                   |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| AD   | USD     | -         | 0,303916 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| BD   | USD     | -         | 0,328835 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| <b>Frontier Markets</b>                      |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| AD   | USD     | -         | 1,722114 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| AD EUR*                                      | USD     | -         | 0,244684 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ID   | USD     | -         | 3,442968 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| XD   | USD     | -         | 0,347054 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ZD   | USD     | -         | 0,733014 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| <b>Global Equity Volatility Focused</b>      |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| AM2  | USD     | 0,024840  | 0,025701 | 0,025085  | 0,024862  | 0,025385  | 0,025850  | 0,025920  | 0,026957  | 0,028329  | 0,027426  | 0,028055  | 0,029038  |
| AM2 HKD*                                     | USD     | 0,003204  | 0,003322 | 0,003235  | 0,003222  | 0,003254  | 0,003343  | 0,003348  | 0,003486  | 0,003652  | 0,003536  | 0,003614  | 0,003748  |
| AM30 AUD*                                    | USD     | 0,006038  | 0,005761 | 0,006653  | 0,008713  | 0,007242  | 0,006599  | 0,007313  | 0,008855  | 0,010217  | 0,008943  | 0,008573  | 0,009221  |
| AM30 CAD*                                    | USD     | 0,012977  | 0,012941 | 0,012296  | 0,013740  | 0,013798  | 0,014383  | 0,014073  | 0,015465  | 0,015611  | 0,014527  | 0,015676  | 0,015802  |
| AM30 EUR*                                    | USD     | 0,001412  | 0,004119 | 0,004290  | 0,004998  | 0,006055  | 0,007031  | 0,009833  | 0,012371  | 0,010651  | 0,008642  | 0,011000  | 0,011769  |
| AM30 RMB*                                    | USD     | -         | -        | -         | -         | -         | 0,000048  | 0,001806  | 0,001415  | -         | -         | -         | -         |
| AM30 SGD*                                    | USD     | 0,008634  | 0,007431 | 0,007642  | 0,006698  | 0,005176  | 0,004637  | 0,005720  | 0,007405  | 0,007605  | 0,006272  | 0,005008  | 0,005484  |
| <b>Brazil Equity</b>                         |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| AD   | USD     | -         | 0,751472 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| AD GBP*                                      | USD     | -         | 0,367796 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| AD HKD*                                      | USD     | -         | 0,024419 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| BD   | USD     | -         | 0,389084 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| BD GBP*                                      | USD     | -         | 0,470938 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ED   | USD     | -         | 0,681974 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ID   | USD     | -         | 0,895741 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| S3D  | USD     | -         | 0,951845 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| <b>Economic Scale US Equity</b>              |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| AD   | USD     | -         | 0,390765 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ADH EUR*                                     | USD     | -         | 0,259528 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| BD   | USD     | -         | 0,111637 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| BD GBP*                                      | USD     | -         | 0,180792 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ID   | USD     | -         | 0,246233 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| PD   | USD     | -         | 0,516536 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| XD   | USD     | -         | 0,185646 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| YD   | USD     | -         | 0,275292 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ZD   | USD     | -         | 0,845221 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |

\* Die in der Erläuterung angegebenen Dividendensätze sind in der Währung des Teilfonds unter Verwendung des maßgeblichen Wechselkurses am Stichtag der jeweiligen Ausschüttung angegeben.

# Erläuterungen zum Abschluss

## für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

### 9. Dividenden (Fortsetzung)

| Teilfonds                    | Währung | Apr. 2023 | Mai 2023 | Jun. 2023 | Jul. 2023 | Aug. 2023 | Sep. 2023 | Okt. 2023 | Nov. 2023 | Dez. 2023 | Jan. 2024 | Feb. 2024 | Mär. 2024 |
|------------------------------|---------|-----------|----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| <b>Indian Equity</b>         |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| ZD                           | USD     | -         | 1,699198 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| <b>Turkey Equity</b>         |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| AD                           | EUR     | -         | 0,269187 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| AD GBP*                      | EUR     | -         | 0,227864 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| BD                           | EUR     | -         | 0,267059 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| BD GBP*                      | EUR     | -         | 0,355176 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| <b>Asia Bond</b>             |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| AM2                          | USD     | 0,045535  | 0,044487 | 0,044641  | 0,040940  | 0,040027  | 0,039565  | 0,038844  | 0,043391  | 0,044525  | 0,044213  | 0,044029  | 0,044131  |
| AM3H SGD*                    | USD     | 0,026637  | 0,024711 | 0,024990  | 0,022584  | 0,020697  | 0,019554  | 0,019620  | 0,023412  | 0,024241  | 0,023707  | 0,022612  | 0,022713  |
| FDH EUR*                     | USD     | -         | 0,304949 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| IDH EUR*                     | USD     | -         | 0,262923 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| S47M3HSGD                    | USD     | -         | -        | -         | -         | -         | -         | 0,025960  | 0,030976  | 0,032075  | 0,031370  | 0,029920  | 0,030059  |
| XDH EUR*                     | USD     | -         | 0,280725 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ZDH EUR*                     | USD     | -         | 0,332299 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ZQ1                          | USD     | -         | -        | 0,080938  | -         | -         | 0,098545  | -         | -         | 0,095511  | -         | -         | 0,102973  |
| ZQ1H AUD*                    | USD     | -         | -        | 0,051803  | -         | -         | 0,061736  | -         | -         | 0,058555  | -         | -         | 0,064345  |
| ZQ1H CHF*                    | USD     | -         | -        | 0,083806  | -         | -         | 0,102857  | -         | -         | 0,097425  | -         | -         | 0,106943  |
| ZQ1H EUR*                    | USD     | -         | -        | 0,083163  | -         | -         | 0,100889  | -         | -         | 0,095388  | -         | -         | 0,104185  |
| ZQ1H GBP*                    | USD     | -         | -        | 0,097047  | -         | -         | 0,119819  | -         | -         | 0,112724  | -         | -         | 0,124918  |
| ZQ1H SGD*                    | USD     | -         | -        | 0,058631  | -         | -         | 0,070514  | -         | -         | 0,067591  | -         | -         | 0,073547  |
| <b>Asia ESG Bond</b>         |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| AM2                          | USD     | 0,049732  | 0,048529 | 0,048907  | 0,045969  | 0,044717  | 0,044375  | 0,043387  | 0,044974  | 0,046020  | 0,048476  | 0,048215  | 0,044421  |
| AM2 HKD*                     | USD     | 0,006381  | 0,006231 | 0,006278  | 0,005908  | 0,005737  | 0,005691  | 0,005571  | 0,005766  | 0,005913  | 0,006221  | 0,006190  | 0,005701  |
| AM30 AUD*                    | USD     | 0,025894  | 0,024476 | 0,025857  | 0,026138  | 0,023390  | 0,022412  | 0,022044  | 0,024001  | 0,025937  | 0,026601  | 0,025747  | 0,023539  |
| AM30 EUR*                    | USD     | 0,036501  | 0,036356 | 0,037293  | 0,036160  | 0,035150  | 0,034145  | 0,034965  | 0,037903  | 0,037738  | 0,039583  | 0,040557  | 0,036602  |
| AM30 GBP*                    | USD     | 0,053241  | 0,053075 | 0,054726  | 0,055842  | 0,053938  | 0,051879  | 0,050640  | 0,054430  | 0,055502  | 0,058097  | 0,058233  | 0,053261  |
| AM30 HKD*                    | USD     | 0,004687  | 0,004510 | 0,005398  | 0,005216  | 0,005319  | 0,004562  | 0,005114  | 0,005181  | 0,005757  | 0,006059  | 0,005256  | 0,004670  |
| AM30 RMB*                    | USD     | 0,004002  | 0,004018 | 0,004156  | 0,003574  | 0,003177  | 0,003855  | 0,004849  | 0,004710  | 0,003625  | 0,003961  | 0,004259  | 0,003653  |
| AM30 SGD*                    | USD     | 0,030368  | 0,028231 | 0,028645  | 0,026847  | 0,024612  | 0,023442  | 0,023374  | 0,025081  | 0,025893  | 0,027380  | 0,026180  | 0,023410  |
| <b>Asia High Yield Bond</b>  |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| ADH EUR*                     | USD     | -         | 0,623060 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| AM                           | USD     | 0,044429  | 0,042384 | 0,041686  | 0,056184  | 0,038048  | 0,031145  | 0,048593  | 0,038084  | 0,007586  | 0,051999  | 0,036694  | 0,057642  |
| AM2                          | USD     | 0,057565  | 0,053506 | 0,054765  | 0,052676  | 0,049379  | 0,050116  | 0,048498  | 0,050434  | 0,047297  | 0,048442  | 0,048624  | 0,044302  |
| AM2 HKD*                     | USD     | 0,006928  | 0,006441 | 0,006589  | 0,006348  | 0,005941  | 0,006027  | 0,005837  | 0,006063  | 0,005693  | 0,005827  | 0,005849  | 0,005330  |
| AM3H AUD*                    | USD     | 0,033060  | 0,030005 | 0,031879  | 0,032247  | 0,028309  | 0,028171  | 0,027259  | 0,029618  | 0,028787  | 0,028374  | 0,027889  | 0,025342  |
| AM3H SGD*                    | USD     | 0,035504  | 0,031976 | 0,032832  | 0,032137  | 0,028964  | 0,028665  | 0,028041  | 0,030006  | 0,028026  | 0,028326  | 0,027759  | 0,024834  |
| BD                           | USD     | -         | 0,518917 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| BDH CHF*                     | USD     | -         | 0,560396 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| BDH EUR*                     | USD     | -         | 0,521354 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| IM2                          | USD     | 0,053095  | 0,049386 | 0,050575  | 0,048673  | 0,045662  | 0,046369  | 0,044905  | 0,046717  | 0,043830  | 0,044931  | 0,045123  | 0,041138  |
| IM3H SGD*                    | USD     | 0,036297  | 0,032713 | 0,033603  | 0,032914  | 0,029685  | 0,028393  | 0,028771  | 0,030810  | 0,028793  | 0,029117  | 0,028549  | 0,025558  |
| PM2                          | USD     | 0,057855  | 0,053786 | 0,055065  | 0,052973  | 0,049666  | 0,050423  | 0,048806  | 0,050761  | 0,047610  | 0,048778  | 0,048971  | 0,044626  |
| PM3H AUD*                    | USD     | 0,033199  | 0,030140 | 0,032025  | 0,032404  | 0,028439  | 0,028305  | 0,027398  | 0,029776  | 0,028954  | 0,028539  | 0,028056  | 0,025493  |
| PM3H EUR*                    | USD     | 0,050948  | 0,047219 | 0,049179  | 0,049068  | 0,045448  | 0,045191  | 0,044768  | 0,048395  | 0,044463  | 0,044548  | 0,045538  | 0,040880  |
| PM3H SGD*                    | USD     | 0,038363  | 0,034560 | 0,035494  | 0,034751  | 0,031329  | 0,031002  | 0,030340  | 0,032471  | 0,030340  | 0,030670  | 0,030059  | 0,026897  |
| S40M2                        | USD     | 0,078603  | 0,073114 | 0,074893  | 0,072098  | 0,067644  | 0,068709  | 0,066549  | 0,069252  | 0,064981  | 0,066631  | 0,066930  | 0,061027  |
| XD                           | USD     | -         | 0,574639 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ZBFIX8.5H JPY*               | USD     | 0,583409  | -        | 0,498887  | -         | 0,474501  | -         | 0,432115  | -         | 0,458181  | -         | 0,443899  | -         |
| ZQ1                          | USD     | -         | -        | 0,150772  | -         | -         | 0,149306  | -         | -         | 0,114891  | -         | -         | 0,170162  |
| ZQ1H AUD*                    | USD     | -         | -        | 0,096589  | -         | -         | 0,094019  | -         | -         | 0,070008  | -         | -         | 0,106403  |
| ZQ1H CHF*                    | USD     | -         | -        | 0,155702  | -         | -         | 0,155590  | -         | -         | 0,116305  | -         | -         | 0,175894  |
| ZQ1H EUR*                    | USD     | -         | -        | 0,154849  | -         | -         | 0,153025  | -         | -         | 0,114171  | -         | -         | 0,171994  |
| ZQ1H GBP*                    | USD     | -         | -        | 0,183339  | -         | -         | 0,184400  | -         | -         | 0,136424  | -         | -         | 0,209432  |
| ZQ1H JPY*                    | USD     | -         | -        | 1,039283  | -         | -         | 0,961181  | -         | -         | 0,700781  | -         | -         | 1,035293  |
| ZQ1H SGD*                    | USD     | -         | -        | 0,110302  | -         | -         | 0,108001  | -         | -         | 0,081644  | -         | -         | 0,122633  |
| <b>Asian Currencies Bond</b> |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| AD                           | USD     | -         | 0,305598 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ID EUR*                      | USD     | -         | 1,017600 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ZD                           | USD     | -         | 0,433672 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| <b>Brazil Bond</b>           |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| AD                           | USD     | -         | 0,259070 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| BD GBP*                      | USD     | -         | 0,091800 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ED                           | USD     | -         | 0,294207 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ZD                           | USD     | -         | 0,342786 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| <b>Euro Bond</b>             |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| AD                           | EUR     | -         | -        | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ID                           | EUR     | -         | 0,042026 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |

\* Die in der Erläuterung angegebenen Dividendensätze sind in der Währung des Teilfonds unter Verwendung des maßgeblichen Wechselkurses am Stichtag der jeweiligen Ausschüttung angegeben.

# Erläuterungen zum Abschluss

für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## 9. Dividenden (Fortsetzung)

| Teilfonds                             | Währung | Apr. 2023 | Mai 2023 | Jun. 2023 | Jul. 2023 | Aug. 2023 | Sep. 2023 | Okt. 2023 | Nov. 2023 | Dez. 2023 | Jan. 2024 | Feb. 2024 | Mär. 2024 |
|---------------------------------------|---------|-----------|----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| <b>Euro Bond Total Return</b>         |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| AD                                    | EUR     | -         | 0,150418 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ID                                    | EUR     | -         | 0,204295 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| <b>Euro Credit Bond</b>               |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| AD                                    | EUR     | -         | 0,170285 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ID                                    | EUR     | -         | 0,149665 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| XD                                    | EUR     | -         | 0,157018 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| <b>Euro High Yield Bond</b>           |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| AD                                    | EUR     | -         | 0,559618 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| AM2                                   | EUR     | 0,049655  | 0,049259 | 0,049579  | 0,051934  | 0,051736  | 0,051281  | 0,050737  | 0,051788  | 0,052894  | 0,046796  | 0,046605  | 0,047092  |
| BD                                    | EUR     | -         | 0,315132 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ED                                    | EUR     | -         | 0,589336 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ID                                    | EUR     | -         | 1,079573 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| S&D                                   | EUR     | -         | 0,364965 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| XD                                    | EUR     | -         | 0,324491 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ZQ1                                   | EUR     | -         | -        | 0,083048  | -         | -         | 0,085256  | -         | -         | 0,087261  | -         | -         | 0,090823  |
| <b>ESG Short Duration Credit Bond</b> |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| AM2                                   | USD     | 0,048499  | 0,047796 | 0,047752  | 0,050374  | 0,050062  | 0,049806  | 0,049347  | 0,053318  | 0,054192  | 0,052510  | 0,052147  | 0,052231  |
| AM2H SGD*                             | USD     | -         | -        | 0,035223  | 0,037860  | 0,036835  | 0,036188  | 0,035905  | 0,039641  | 0,040596  | 0,038665  | 0,038173  | 0,038200  |
| AM3H AUD*                             | USD     | 0,023706  | 0,022534 | 0,023815  | 0,028050  | 0,025536  | 0,024396  | 0,024388  | 0,028179  | 0,030292  | 0,028011  | 0,027029  | 0,027383  |
| AM3H EUR*                             | USD     | 0,031569  | 0,032283 | 0,032831  | 0,037791  | 0,037624  | 0,036765  | 0,038345  | 0,044271  | 0,043662  | 0,040824  | 0,042139  | 0,042280  |
| AM3H GBP*                             | USD     | 0,050067  | 0,050816 | 0,051926  | 0,060916  | 0,060258  | 0,058117  | 0,057494  | 0,064547  | 0,065355  | 0,062616  | 0,062762  | 0,062645  |
| AM3H SGD*                             | USD     | 0,028104  | 0,026082 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| BM2                                   | USD     | 0,048543  | 0,047853 | 0,047820  | 0,050465  | 0,050174  | 0,049929  | 0,049485  | 0,053487  | 0,054370  | 0,052705  | 0,052358  | 0,052453  |
| BM3H CHF*                             | USD     | 0,014324  | 0,015221 | 0,016594  | 0,021959  | 0,020742  | 0,019328  | 0,018558  | 0,024231  | 0,023851  | 0,021547  | 0,022722  | 0,022061  |
| BM3H EUR*                             | USD     | 0,031597  | 0,032318 | 0,032878  | 0,037861  | 0,037704  | 0,036851  | 0,038450  | 0,044405  | 0,043806  | 0,040976  | 0,042306  | 0,042460  |
| BM3H GBP*                             | USD     | 0,050111  | 0,050883 | 0,052010  | 0,061033  | 0,060394  | 0,058266  | 0,057661  | 0,064758  | 0,065578  | 0,062862  | 0,063022  | 0,062922  |
| ZQ1                                   | USD     | -         | -        | 0,096007  | -         | -         | 0,148210  | -         | -         | 0,138253  | -         | -         | 0,145563  |
| ZQ1H CHF*                             | USD     | -         | -        | 0,104201  | -         | -         | 0,168042  | -         | -         | 0,149757  | -         | -         | 0,160271  |
| ZQ1H EUR*                             | USD     | -         | -        | 0,102459  | -         | -         | 0,173452  | -         | -         | 0,145267  | -         | -         | 0,154669  |
| ZQ1H GBP*                             | USD     | -         | -        | 0,119842  | -         | -         | 0,185851  | -         | -         | 0,169955  | -         | -         | 0,183567  |
| <b>GEM Debt Total Return</b>          |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| L1D                                   | USD     | -         | 0,469788 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| L1DH EUR*                             | USD     | -         | 0,299871 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| M1D                                   | USD     | -         | 0,401625 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| M1D EUR*                              | USD     | -         | 0,400924 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| M1DH EUR*                             | USD     | -         | 0,301914 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| N1DH EUR*                             | USD     | -         | 0,336207 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| <b>Global Bond</b>                    |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| AD                                    | USD     | -         | 0,158774 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| AM2                                   | USD     | -         | -        | -         | -         | -         | -         | -         | -         | 0,033500  | 0,035341  | 0,034924  | 0,034999  |
| AM2 HKD*                              | USD     | 0,003164  | 0,003036 | 0,003061  | 0,003364  | 0,003245  | 0,003176  | 0,003119  | 0,003262  | 0,003394  | 0,003585  | 0,003543  | 0,003551  |
| PD                                    | USD     | -         | 0,154330 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ZD                                    | USD     | -         | 0,269850 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| <b>Global Bond Total Return</b>       |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| IQ1H EUR*                             | USD     | -         | -        | 0,097723  | -         | -         | 0,126673  | -         | -         | 0,132632  | -         | -         | 0,123024  |
| IQ1H GBP*                             | USD     | -         | -        | 0,115514  | -         | -         | 0,152073  | -         | -         | 0,158400  | -         | -         | 0,149090  |
| XQ1H GBP*                             | USD     | -         | -        | 0,115712  | -         | -         | 0,152660  | -         | -         | 0,159172  | -         | -         | 0,149567  |
| ZQ1                                   | USD     | -         | -        | 0,092392  | -         | -         | 0,120726  | -         | -         | 0,129640  | -         | -         | 0,118967  |
| ZQ1H GBP*                             | USD     | -         | -        | 0,114402  | -         | -         | 0,150810  | -         | -         | 0,157158  | -         | -         | 0,148173  |
| <b>Global Corporate Bond</b>          |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| BQ1H GBP*                             | USD     | -         | -        | 0,087742  | -         | -         | 0,104396  | -         | -         | 0,102541  | -         | -         | 0,111034  |
| ZBFIx8.5H JPY*                        | USD     | 0,718632  | -        | 0,656880  | -         | 0,634145  | -         | 0,596724  | -         | -         | -         | -         | -         |
| ZD                                    | USD     | -         | 0,291240 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ZDH GBP*                              | USD     | -         | 0,306672 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ZM1H JPY*                             | USD     | 0,153884  | 0,178063 | 0,171944  | 0,208157  | 0,195115  | 0,156050  | 0,190003  | 0,198517  | -         | -         | -         | -         |
| ZQ1                                   | USD     | -         | -        | 0,081168  | -         | -         | 0,086871  | -         | -         | 0,098000  | -         | -         | 0,103635  |
| ZQ1H AUD*                             | USD     | -         | -        | 0,049894  | -         | -         | 0,058346  | -         | -         | 0,057870  | -         | -         | 0,062201  |
| ZQ1H CHF*                             | USD     | -         | -        | 0,073357  | -         | -         | 0,088335  | -         | -         | 0,087417  | -         | -         | 0,093794  |
| ZQ1H EUR*                             | USD     | -         | -        | 0,073671  | -         | -         | 0,088871  | -         | -         | 0,086668  | -         | -         | 0,092801  |
| ZQ1H GBP*                             | USD     | -         | -        | 0,093841  | -         | -         | 0,113586  | -         | -         | 0,111725  | -         | -         | 0,121133  |
| ZQ1H JPY*                             | USD     | -         | -        | 0,507461  | -         | -         | 0,566136  | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ZQ1H SGD*                             | USD     | -         | -        | 0,054934  | -         | -         | 0,064799  | -         | -         | 0,064949  | -         | -         | 0,069164  |
| <b>Global Emerging Markets Bond</b>   |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| AD                                    | USD     | -         | 0,860112 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| AD GBP*                               | USD     | -         | 0,483527 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ADH EUR*                              | USD     | -         | 0,372803 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| AM2                                   | USD     | 0,097695  | 0,095604 | 0,097144  | 0,099353  | 0,097080  | 0,095180  | 0,092140  | 0,096244  | 0,100728  | 0,096249  | 0,096989  | 0,098423  |

\* Die in der Erläuterung angegebenen Dividendensätze sind in der Währung des Teilfonds unter Verwendung des maßgeblichen Wechselkurses am Stichtag der jeweiligen Ausschüttung angegeben.

# Erläuterungen zum Abschluss

für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## 9. Dividenden (Fortsetzung)

| Teilfonds   | Währung | Apr. 2023 | Mai 2023 | Jun. 2023 | Jul. 2023 | Aug. 2023 | Sep. 2023 | Okt. 2023 | Nov. 2023 | Dez. 2023 | Jan. 2024 | Feb. 2024 | Mär. 2024 |
|---|---------|-----------|----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| <b>Global Emerging Markets Bond (Fortsetzung)</b>         |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| AM2 HKD*  | USD     | 0,004926  | 0,004821 | 0,004898  | 0,005017  | 0,004894  | 0,004796  | 0,004646  | 0,004848  | 0,005080  | 0,004851  | 0,004888  | 0,004961  |
| AM3H AUD*   | USD     | 0,018463  | 0,017558 | 0,018660  | 0,020495  | 0,018566  | 0,017676  | 0,017177  | 0,018801  | 0,020693  | 0,018902  | 0,018581  | 0,019045  |
| AM3H EUR*   | USD     | 0,026111  | 0,025860 | 0,026743  | 0,028708  | 0,027870  | 0,026794  | 0,026873  | 0,029264  | 0,030054  | 0,027810  | 0,028813  | 0,029274  |
| AM3H SGD*   | USD     | 0,021584  | 0,020233 | 0,020670  | 0,021454  | 0,019924  | 0,018873  | 0,018562  | 0,020016  | 0,021135  | 0,019738  | 0,019204  | 0,019527  |
| BD GBP*   | USD     | -         | 0,509008 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| BQ1H GBP*   | USD     | -         | -        | 0,147072  | -         | -         | 0,177018  | -         | -         | 0,174049  | -         | -         | 0,179520  |
| ED  | USD     | -         | 0,659835 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ID EUR*   | USD     | -         | 0,455099 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| IDH EUR*  | USD     | -         | 0,460327 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| PD  | USD     | -         | 0,595801 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| XDH EUR*  | USD     | -         | 0,491261 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ZBFIX8.5H JPY*  | USD     | 0,628725  | -        | 0,573721  | -         | 0,571903  | -         | 0,525606  | -         | -         | -         | -         | -         |
| ZD  | USD     | -         | 0,860615 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ZM1H JPY*   | USD     | 0,229958  | 0,229820 | 0,215479  | 0,275637  | 0,267718  | 0,220830  | 0,242821  | 0,302264  | -         | -         | -         | -         |
| ZQ1   | USD     | -         | -        | 0,105242  | -         | -         | 0,127779  | -         | -         | 0,129212  | -         | -         | 0,130588  |
| ZQ1H AUD*   | USD     | -         | -        | 0,070119  | -         | -         | 0,083326  | -         | -         | 0,082823  | -         | -         | 0,084809  |
| ZQ1H CHF*   | USD     | -         | -        | 0,097120  | -         | -         | 0,118918  | -         | -         | 0,117822  | -         | -         | 0,120623  |
| ZQ1H EUR*   | USD     | -         | -        | 0,095706  | -         | -         | 0,115827  | -         | -         | 0,114746  | -         | -         | 0,116922  |
| ZQ1H GBP*   | USD     | -         | -        | 0,121744  | -         | -         | 0,149925  | -         | -         | 0,147750  | -         | -         | 0,152710  |
| ZQ1H JPY*   | USD     | -         | -        | 0,685218  | -         | -         | 0,776375  | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ZQ1H SGD*   | USD     | -         | -        | 0,072459  | -         | -         | 0,086905  | -         | -         | 0,087224  | -         | -         | 0,088603  |
| <b>Global Emerging Markets Corporate Sustainable Bond</b> |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| AD  | USD     | -         | 0,301503 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ID  | USD     | -         | 0,340304 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ZQ1   | USD     | -         | -        | 0,167965  | -         | -         | 0,190453  | -         | -         | 0,387689  | -         | -         | -         |
| <b>Global Emerging Markets ESG Bond</b>                   |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| ZQ1   | USD     | -         | -        | 0,136291  | -         | -         | 0,137546  | -         | -         | 0,129410  | -         | -         | 0,142509  |
| ZQ1H EUR*   | USD     | -         | -        | 0,167622  | -         | -         | 0,169857  | -         | -         | 0,156247  | -         | -         | 0,163121  |
| ZQ1H GBP*   | USD     | -         | -        | 0,187153  | -         | -         | 0,192489  | -         | -         | 0,178207  | -         | -         | 0,193913  |
| <b>Global Emerging Markets ESG Local Debt</b>             |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| ZD  | USD     | -         | 0,394850 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ZQ1   | USD     | -         | -        | 0,144786  | -         | -         | 0,169144  | -         | -         | 0,148263  | -         | -         | 0,154086  |
| <b>Global Emerging Markets Local Debt</b>                 |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| AD  | USD     | -         | 0,231888 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| BD GBP*   | USD     | -         | 0,362811 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| BQ1   | USD     | -         | -        | 0,172645  | -         | -         | 0,238185  | -         | -         | 0,155799  | -         | -         | 0,176903  |
| ID  | USD     | -         | 0,299136 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ID EUR*   | USD     | -         | 0,311082 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| XD  | USD     | -         | 0,241486 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ZBFIX8.5 JPY*   | USD     | 0,927179  | -        | 0,888884  | -         | 0,920652  | -         | 0,894348  | -         | 0,954246  | -         | 0,887496  | -         |
| ZD  | USD     | -         | 0,342698 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ZM2   | USD     | 0,037451  | 0,036888 | 0,037670  | 0,041119  | 0,040113  | 0,039036  | 0,038602  | 0,040421  | 0,040734  | 0,042545  | 0,042446  | 0,042200  |
| ZQ1   | USD     | -         | -        | 0,130933  | -         | -         | 0,180974  | -         | -         | 0,118641  | -         | -         | 0,135002  |
| <b>Global ESG Corporate Bond</b>                          |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| ZQ1   | USD     | -         | -        | 0,059847  | -         | -         | 0,072197  | -         | -         | 0,071825  | -         | -         | 0,076733  |
| ZQ1H EUR*   | USD     | -         | -        | 0,063279  | -         | -         | 0,075602  | -         | -         | 0,073700  | -         | -         | 0,083372  |
| ZQ1H GBP*   | USD     | -         | -        | 0,074192  | -         | -         | 0,090340  | -         | -         | 0,088067  | -         | -         | 0,098253  |
| <b>Global Government Bond</b>                             |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| BQ1H GBP*   | USD     | -         | -        | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | 0,068057  |
| ZBFIX8.5H JPY*  | USD     | 0,713467  | -        | 0,646405  | -         | 0,613936  | -         | 0,573098  | -         | -         | -         | -         | -         |
| ZD  | USD     | -         | 0,132659 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ZM1H JPY*   | USD     | 0,092513  | 0,078058 | 0,102432  | 0,108206  | 0,108162  | 0,107397  | 0,121469  | 0,140086  | -         | -         | -         | -         |
| ZQ1   | USD     | -         | -        | 0,042779  | -         | -         | 0,054873  | -         | -         | 0,065086  | -         | -         | 0,069780  |
| ZQ1H AUD*   | USD     | -         | -        | 0,027055  | -         | -         | 0,034014  | -         | -         | 0,039578  | -         | -         | 0,043097  |
| ZQ1H CHF*   | USD     | -         | -        | 0,039587  | -         | -         | 0,051201  | -         | -         | 0,059425  | -         | -         | 0,064588  |
| ZQ1H EUR*   | USD     | -         | -        | 0,039898  | -         | -         | 0,051420  | -         | -         | 0,059085  | -         | -         | 0,063976  |
| ZQ1H GBP*   | USD     | -         | -        | 0,049974  | -         | -         | 0,065015  | -         | -         | 0,075012  | -         | -         | 0,082437  |
| ZQ1H JPY*   | USD     | -         | -        | 0,270543  | -         | -         | 0,323765  | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ZQ1H SGD*   | USD     | -         | -        | 0,030184  | -         | -         | 0,038251  | -         | -         | 0,044954  | -         | -         | 0,048507  |
| <b>Global Green Bond</b>                                  |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| ZQ1   | USD     | -         | -        | 0,057468  | -         | -         | 0,069687  | -         | -         | 0,071280  | -         | -         | 0,074898  |
| ZQ1H EUR*   | USD     | -         | -        | 0,068356  | -         | -         | 0,086652  | -         | -         | 0,086467  | -         | -         | 0,091369  |
| ZQ1H GBP*   | USD     | -         | -        | 0,078667  | -         | -         | 0,099794  | -         | -         | 0,100980  | -         | -         | 0,107818  |
| <b>Global High Income Bond</b>                            |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| AD  | USD     | -         | 0,288233 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ADH EUR*  | USD     | -         | 0,203859 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| AM2   | USD     | 0,053892  | 0,052774 | 0,052973  | 0,048637  | 0,047945  | 0,047490  | 0,046501  | 0,047890  | 0,049346  | 0,048644  | 0,048355  | 0,048602  |

\* Die in der Erläuterung angegebenen Dividendensätze sind in der Währung des Teilfonds unter Verwendung des maßgeblichen Wechselkurses am Stichtag der jeweiligen Ausschüttung angegeben.

# Erläuterungen zum Abschluss

für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## 9. Dividenden (Fortsetzung)

| Teilfonds  | Währung | Apr. 2023 | Mai 2023 | Jun. 2023 | Jul. 2023 | Aug. 2023 | Sep. 2023 | Okt. 2023 | Nov. 2023 | Dez. 2023 | Jan. 2024 | Feb. 2024 | Mär. 2024 |
|--|---------|-----------|----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| <b>Global High Income Bond (Fortsetzung)</b>           |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| AM3H AUD*  | USD     | 0,026102  | 0,024827 | 0,026092  | 0,025359  | 0,023070  | 0,022100  | 0,021767  | 0,023537  | 0,025575  | 0,024160  | 0,023390  | 0,023758  |
| AM3H EUR*  | USD     | 0,037369  | 0,037086 | 0,037881  | 0,035291  | 0,034680  | 0,033701  | 0,034395  | 0,036998  | 0,037203  | 0,035656  | 0,036613  | 0,036849  |
| AM3H RMB*  | USD     | 0,004459  | 0,004462 | 0,004558  | 0,003778  | 0,003428  | 0,004070  | 0,005027  | 0,004882  | 0,003879  | 0,003770  | 0,004057  | 0,004000  |
| AM3H SGD*  | USD     | 0,034190  | 0,032039 | 0,032343  | 0,029374  | 0,027370  | 0,026078  | 0,026010  | 0,027703  | 0,028797  | 0,027857  | 0,026609  | 0,026799  |
| BD   | USD     | -         | 0,280495 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ID   | USD     | -         | 0,291715 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| IM2  | USD     | 0,055355  | 0,054237 | 0,054468  | 0,050044  | 0,049365  | 0,048916  | 0,047927  | 0,049383  | 0,050906  | 0,050218  | 0,049948  | 0,050224  |
| XDH EUR*   | USD     | -         | 0,308667 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| <b>Global High Yield Bond</b>                          |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| AD   | USD     | -         | 0,414872 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| AM2  | USD     | 0,058502  | 0,057516 | 0,057720  | 0,052736  | 0,052233  | 0,051696  | 0,050662  | 0,052164  | 0,053583  | 0,051139  | 0,050803  | 0,050869  |
| AM2 HKD*   | USD     | 0,007540  | 0,007415 | 0,007440  | 0,006808  | 0,006731  | 0,006658  | 0,006531  | 0,006717  | 0,006909  | 0,006588  | 0,006545  | 0,006555  |
| AM3H AUD*  | USD     | 0,031760  | 0,030394 | 0,031821  | 0,030517  | 0,028028  | 0,026937  | 0,026505  | 0,028609  | 0,030908  | 0,028105  | 0,027228  | 0,027546  |
| AM3H EUR*  | USD     | 0,046212  | 0,045737 | 0,046703  | 0,043158  | 0,042481  | 0,041225  | 0,041864  | 0,044947  | 0,045302  | 0,041632  | 0,042570  | 0,042881  |
| AM3H RMB*  | USD     | 0,005606  | 0,005584 | 0,005663  | 0,004747  | 0,004380  | 0,005024  | 0,005991  | 0,005889  | 0,004872  | 0,004494  | 0,004779  | 0,004704  |
| BD   | USD     | -         | 0,622969 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| BQ1H GBP*  | USD     | -         | 0,622969 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ID   | USD     | -         | 0,473039 | -         | -         | -         | 0,712755  | -         | -         | 0,710932  | -         | -         | 0,758413  |
| ZBFIx8.5H JPY*   | USD     | 0,754445  | -        | 0,688231  | -         | 0,677754  | -         | 0,643818  | -         | 0,679840  | -         | 0,648196  | -         |
| ZD   | USD     | -         | 0,528750 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ZDH GBP*   | USD     | -         | 0,573386 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ZM1H JPY*  | USD     | 0,272924  | 0,296123 | 0,255250  | 0,296045  | 0,296666  | 0,231725  | 0,340129  | 0,262331  | 0,208301  | 0,316084  | 0,245493  | 0,272457  |
| ZQ1  | USD     | -         | -        | 0,128069  | -         | -         | 0,138221  | -         | -         | 0,142237  | -         | -         | 0,147999  |
| ZQ1H AUD*  | USD     | -         | -        | 0,080467  | -         | -         | 0,085030  | -         | -         | 0,085664  | -         | -         | 0,090702  |
| ZQ1H CHF*  | USD     | -         | -        | 0,120351  | -         | -         | 0,131001  | -         | -         | 0,131784  | -         | -         | 0,139167  |
| ZQ1H EUR*  | USD     | -         | -        | 0,118053  | -         | -         | 0,126996  | -         | -         | 0,127520  | -         | -         | 0,134287  |
| ZQ1H GBP*  | USD     | -         | -        | 0,145284  | -         | -         | 0,159056  | -         | -         | 0,158880  | -         | -         | 0,169769  |
| ZQ1H JPY*  | USD     | -         | -        | 0,867284  | -         | -         | 0,872871  | -         | -         | 0,857670  | -         | -         | 0,883806  |
| ZQ1H SGD*  | USD     | -         | -        | 0,088757  | -         | -         | 0,094629  | -         | -         | 0,096372  | -         | -         | 0,101078  |
| <b>Global High Yield ESG Bond</b>                      |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| ZQ1  | USD     | -         | -        | 0,122697  | -         | -         | 0,138380  | -         | -         | 0,130379  | -         | -         | 0,141038  |
| ZQ1H EUR*  | USD     | -         | -        | 0,139551  | -         | -         | 0,151186  | -         | -         | 0,144470  | -         | -         | 0,157916  |
| ZQ1H GBP*  | USD     | -         | -        | 0,159425  | -         | -         | 0,175822  | -         | -         | 0,168647  | -         | -         | 0,185459  |
| <b>Global High Yield Securitised Credit Bond</b>       |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| ZQ1H JPY*  | USD     | -         | -        | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | 1,219950  |
| <b>Global Inflation Linked Bond</b>                    |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| AD   | USD     | -         | 0,604446 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ZQ1  | USD     | -         | -        | 0,166706  | -         | -         | 0,070301  | -         | -         | 0,085212  | -         | -         | -         |
| ZQ1H CHF*  | USD     | -         | -        | 0,184644  | -         | -         | 0,078792  | -         | -         | 0,092748  | -         | -         | -         |
| ZQ1H EUR*  | USD     | -         | -        | 0,158935  | -         | -         | 0,067297  | -         | -         | 0,078826  | -         | -         | -         |
| ZQ1H GBP*  | USD     | -         | -        | 0,193526  | -         | -         | 0,083263  | -         | -         | 0,096971  | -         | -         | -         |
| ZQ1H JPY*  | USD     | -         | -        | 1,152832  | -         | -         | 0,458817  | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ZQ1H SGD*  | USD     | -         | -        | 0,129508  | -         | -         | 0,054184  | -         | -         | 0,064566  | -         | -         | -         |
| <b>Global Investment Grade Securitised Credit Bond</b> |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| ADH EUR*   | USD     | -         | 0,236426 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| AM2  | USD     | 0,045030  | 0,044991 | 0,049457  | 0,052030  | 0,052052  | 0,052109  | 0,051985  | 0,052058  | 0,052171  | 0,052869  | 0,052858  | 0,052903  |
| AM2 HKD*   | USD     | 0,005735  | 0,005730 | 0,006299  | 0,006636  | 0,006627  | 0,006632  | 0,006622  | 0,006624  | 0,006641  | 0,006731  | 0,006730  | 0,006736  |
| AM3H AUD*  | USD     | 0,023102  | 0,022270 | 0,026678  | 0,030965  | 0,028517  | 0,027534  | 0,027670  | 0,029139  | 0,030857  | 0,030085  | 0,029265  | 0,029616  |
| AM3H GBP*  | USD     | 0,049950  | 0,051397 | 0,058660  | 0,067981  | 0,067559  | 0,065551  | 0,065298  | 0,067822  | 0,067748  | 0,068024  | 0,068599  | 0,068422  |
| AM3H RMB*  | USD     | 0,002990  | 0,003154 | 0,003914  | 0,004009  | 0,003660  | 0,004502  | 0,005809  | 0,005442  | 0,004075  | 0,004126  | 0,004502  | 0,004415  |
| AM3H SGD*  | USD     | 0,026391  | 0,024846 | 0,028401  | 0,030582  | 0,028819  | 0,031746  | 0,031645  | 0,031545  | 0,031446  | 0,029715  | 0,028472  | 0,028560  |
| AM3HJPY*   | USD     | -         | -        | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | 0,064926  |
| BDH EUR*   | USD     | -         | 0,283768 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| BQ1H GBP*  | USD     | -         | -        | 0,146855  | -         | -         | 0,182661  | -         | -         | 0,164487  | -         | -         | 0,192948  |
| ZBFIx8.5H JPY*   | USD     | 0,796000  | -        | 0,735838  | -         | 0,714863  | -         | 0,694214  | -         | 0,718854  | -         | 0,675577  | -         |
| ZM1H JPY*  | USD     | 0,256252  | 0,294134 | 0,272115  | 0,330792  | 0,315033  | 0,297101  | 0,288307  | 0,308325  | 0,293971  | 0,383543  | 0,289914  | 0,275229  |
| ZQ1  | USD     | -         | -        | 0,124866  | -         | -         | 0,153338  | -         | -         | 0,142301  | -         | -         | 0,162901  |
| ZQ1H AUD*  | USD     | -         | -        | 0,081241  | -         | -         | 0,097774  | -         | -         | 0,088973  | -         | -         | 0,103717  |
| ZQ1H CHF*  | USD     | -         | -        | 0,127115  | -         | -         | 0,157596  | -         | -         | 0,142916  | -         | -         | 0,166383  |
| ZQ1H EUR*  | USD     | -         | -        | 0,149611  | -         | -         | 0,186370  | -         | -         | 0,168092  | -         | -         | 0,197457  |
| ZQ1H GBP*  | USD     | -         | -        | 0,091617  | -         | -         | 0,111235  | -         | -         | 0,102205  | -         | -         | 0,117960  |
| ZQ2H EUR*  | USD     | -         | -        | 0,156896  | -         | -         | 0,160094  | -         | -         | 0,167844  | -         | -         | 0,165685  |
| <b>Global Lower Carbon Bond</b>                        |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| AD   | USD     | -         | 0,145570 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ADH EUR*   | USD     | -         | 0,126394 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| AM2  | USD     | 0,043923  | 0,042862 | 0,042996  | 0,043731  | 0,043047  | 0,042623  | 0,041899  | 0,043209  | 0,044834  | 0,043995  | 0,043468  | 0,043688  |
| AM2 HKD*   | USD     | 0,005591  | 0,005456 | 0,005473  | 0,005575  | 0,005478  | 0,005422  | 0,005334  | 0,005495  | 0,005708  | 0,005598  | 0,005531  | 0,005559  |
| AM3H AUD*  | USD     | 0,019601  | 0,018451 | 0,019584  | 0,022053  | 0,019845  | 0,018836  | 0,018696  | 0,020309  | 0,022347  | 0,021009  | 0,020133  | 0,020474  |
| AM3H SGD*  | USD     | 0,023307  | 0,021422 | 0,021690  | 0,022308  | 0,020516  | 0,019363  | 0,019486  | 0,020857  | 0,021831  | 0,021005  | 0,019701  | 0,019852  |
| ZQ1  | USD     | -         | -        | 0,066020  | -         | -         | 0,079091  | -         | -         | 0,084002  | -         | -         | 0,090094  |
| ZQ1H CHF*  | USD     | -         | -        | 0,060862  | -         | -         | 0,073508  | -         | -         | 0,076332  | -         | -         | 0,082803  |
| ZQ1H EUR*  | USD     | -         | -        | 0,060493  | -         | -         | 0,073316  | -         | -         | 0,074967  | -         | -         | 0,081162  |
| ZQ1H GBP*  | USD     | -         | -        | 0,073984  | -         | -         | 0,089830  | -         | -         | 0,093283  | -         | -         | 0,102085  |

\* Die in der Erläuterung angegebenen Dividendensätze sind in der Währung des Teilfonds unter Verwendung des maßgeblichen Wechselkurses am Stichtag der jeweiligen Ausschüttung angegeben.

# Erläuterungen zum Abschluss

## für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

### 9. Dividenden (Fortsetzung)

| Teilfonds                             | Währung | Apr. 2023 | Mai 2023 | Jun. 2023 | Jul. 2023 | Aug. 2023 | Sep. 2023 | Okt. 2023 | Nov. 2023 | Dez. 2023 | Jan. 2024 | Feb. 2024 | Mär. 2024 |
|---------------------------------------|---------|-----------|----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| <b>Global Securitised Credit Bond</b> |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| XD                                    | USD     | -         | 0,439036 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| XDH GBP*                              | USD     | -         | 0,535561 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ZQ1                                   | USD     | -         | -        | 0,161950  | -         | -         | -         | 0,177915  | -         | 0,184460  | -         | -         | 0,182642  |
| ZQ1H EUR*                             | USD     | -         | -        | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | 0,176450  |
| ZQ1H GBP*                             | USD     | -         | -        | 0,206898  | -         | -         | -         | 0,232429  | -         | 0,233058  | -         | -         | 0,233665  |
| ZQ1H JPY*                             | USD     | -         | -        | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | 1,001016  |
| <b>Global Short Duration Bond</b>     |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| AM2                                   | USD     | 0,047705  | 0,047159 | 0,046984  | 0,049316  | 0,049176  | 0,049077  | 0,048886  | 0,049310  | 0,049989  | 0,049362  | 0,048994  | 0,049091  |
| AM2 HKD*                              | USD     | 0,006107  | 0,006038 | 0,006015  | 0,006322  | 0,006293  | 0,006278  | 0,006259  | 0,006306  | 0,006395  | 0,006317  | 0,006270  | 0,006282  |
| AM3H AUD*                             | USD     | 0,023337  | 0,022264 | 0,023450  | 0,027400  | 0,025050  | 0,024024  | 0,024146  | 0,025639  | 0,027528  | 0,026028  | 0,025088  | 0,025428  |
| AM3H CAD*                             | USD     | -         | -        | -         | -         | -         | -         | -         | -         | 0,036479  | 0,035371  | 0,035534  | 0,035197  |
| AM3H EUR*                             | USD     | -         | -        | -         | -         | -         | -         | -         | -         | 0,042318  | 0,040564  | 0,041916  | 0,042075  |
| AM3H GBP*                             | USD     | -         | -        | -         | -         | -         | -         | -         | -         | 0,064483  | 0,063019  | 0,063161  | 0,063046  |
| AM3H RMB*                             | USD     | 0,003190  | 0,003322 | 0,003454  | 0,003500  | 0,003145  | 0,003991  | 0,005312  | 0,004959  | 0,003605  | 0,003494  | 0,003854  | 0,003772  |
| AM3HJPY*                              | USD     | -         | -        | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | 0,028112  |
| ZQ1                                   | USD     | -         | -        | 0,094819  | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ZQ1H GBP*                             | USD     | -         | -        | 0,112602  | -         | -         | -         | 0,140914  | -         | 0,134587  | -         | -         | 0,147952  |
| <b>India Fixed Income</b>             |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| AD                                    | USD     | -         | 0,380486 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| AM2                                   | USD     | 0,042848  | 0,042412 | 0,042609  | 0,042518  | 0,041819  | 0,041403  | 0,040961  | 0,041041  | 0,041323  | 0,040838  | 0,041020  | 0,040576  |
| AM2 HKD*                              | USD     | 0,006497  | 0,006433 | 0,006459  | 0,006458  | 0,006340  | 0,006274  | 0,006213  | 0,006218  | 0,006268  | 0,006190  | 0,006218  | 0,006152  |
| AM3O AUD*                             | USD     | 0,026523  | 0,025464 | 0,026838  | 0,028918  | 0,028261  | 0,025152  | 0,025032  | 0,026336  | 0,027966  | 0,026495  | 0,025924  | 0,025921  |
| AM3O CAD*                             | USD     | -         | -        | -         | -         | -         | -         | -         | -         | 0,043099  | 0,041847  | 0,042382  | 0,041526  |
| AM3O EUR*                             | USD     | 0,037588  | 0,037879 | 0,038734  | 0,040550  | 0,039738  | 0,038604  | 0,039784  | 0,041632  | 0,040938  | 0,039347  | 0,040805  | 0,040421  |
| AM3O GBP*                             | USD     | -         | -        | -         | -         | -         | -         | -         | -         | 0,075622  | 0,073988  | 0,074897  | 0,073843  |
| AM3O RMB*                             | USD     | 0,004163  | 0,004236 | 0,004353  | 0,004122  | 0,003735  | 0,004420  | 0,005499  | 0,005201  | 0,004055  | 0,003952  | 0,004291  | 0,004167  |
| AM3O SGD*                             | USD     | 0,026120  | 0,024662 | 0,024940  | 0,025135  | 0,023380  | 0,022275  | 0,022443  | 0,023253  | 0,023629  | 0,022918  | 0,022132  | 0,021943  |
| AM3OJPY*                              | USD     | -         | -        | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | 0,091030  |
| BD                                    | USD     | -         | 0,484942 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| BD GBP*                               | USD     | -         | 0,723840 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ID                                    | USD     | -         | 0,467902 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ID EUR*                               | USD     | -         | 0,526087 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ID GBP*                               | USD     | -         | 0,573652 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| IM2                                   | USD     | 0,047538  | 0,047078 | 0,047323  | 0,047255  | 0,046501  | 0,046600  | 0,045599  | 0,045710  | 0,046048  | 0,045537  | 0,045762  | 0,045288  |
| XD                                    | USD     | -         | 0,482232 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| XM2                                   | USD     | 0,046324  | 0,045876 | 0,046122  | 0,046060  | 0,045331  | 0,044902  | 0,044461  | 0,044571  | 0,044902  | 0,044414  | 0,044632  | 0,044177  |
| ZD                                    | USD     | -         | 0,552963 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| <b>RMB Fixed Income</b>               |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| AD                                    | USD     | -         | 0,242366 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| AD EUR*                               | USD     | -         | 0,325037 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| AM2                                   | USD     | 0,033480  | 0,032669 | 0,032283  | 0,028234  | 0,027397  | 0,027189  | 0,027053  | 0,027812  | 0,027848  | 0,025481  | 0,025481  | 0,025324  |
| AM2 HKD*                              | USD     | 0,004050  | 0,003951 | 0,003901  | 0,003424  | 0,003318  | 0,003284  | 0,003273  | 0,003356  | 0,003369  | 0,003079  | 0,003081  | 0,003061  |
| AM2 RMB*                              | USD     | 0,004814  | 0,004685 | 0,004621  | 0,004054  | 0,003939  | 0,003915  | 0,003891  | 0,004016  | 0,004006  | 0,003666  | 0,003665  | 0,003637  |
| AM3O SGD*                             | USD     | 0,017483  | 0,015724 | 0,015760  | 0,012709  | 0,011041  | 0,010077  | 0,010475  | 0,011328  | 0,011441  | 0,009525  | 0,008489  | 0,008480  |
| ID                                    | USD     | -         | 0,287235 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| XD EUR*                               | USD     | -         | 0,177291 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| XD1O EUR*                             | USD     | -         | 0,354408 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| <b>Singapore Dollar Income Bond</b>   |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| AM2                                   | USD     | 0,037271  | 0,036677 | 0,036846  | 0,035633  | 0,035172  | 0,035267  | 0,035046  | 0,035339  | 0,035754  | 0,032407  | 0,032432  | 0,032574  |
| AM3H AUD*                             | USD     | 0,030140  | 0,030349 | 0,032277  | 0,033322  | 0,032121  | 0,032095  | 0,031741  | 0,032413  | 0,035128  | 0,031321  | 0,030595  | 0,031126  |
| AM3H USD*                             | USD     | 0,061807  | 0,062216 | 0,062415  | 0,059906  | 0,061967  | 0,064134  | 0,063150  | 0,061544  | 0,062186  | 0,058723  | 0,060304  | 0,060406  |
| <b>Ultra Short Duration Bond</b>      |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| BM2                                   | USD     | 0,043671  | 0,043646 | 0,043595  | 0,046131  | 0,046121  | 0,046131  | 0,046143  | 0,046186  | 0,046256  | 0,048894  | 0,048881  | 0,048877  |
| BM3H GBP*                             | USD     | 0,044011  | 0,045497 | 0,046423  | 0,055219  | 0,055068  | 0,053391  | 0,053323  | 0,055264  | 0,055037  | 0,057845  | 0,058421  | 0,058202  |
| PM2                                   | USD     | 0,043080  | 0,043051 | 0,042910  | 0,045389  | 0,045380  | 0,045321  | 0,045301  | 0,045315  | 0,045383  | 0,048014  | 0,047999  | 0,047999  |
| PM2 HKD*                              | USD     | 0,005551  | 0,005548 | 0,005524  | 0,005852  | 0,005840  | 0,005830  | 0,005833  | 0,005828  | 0,005844  | 0,006179  | 0,006177  | 0,006178  |
| PM3H AUD*                             | USD     | 0,020054  | 0,019266 | 0,020425  | 0,024566  | 0,022369  | 0,021321  | 0,021562  | 0,022758  | 0,024242  | 0,025002  | 0,024240  | 0,024534  |
| PM3H EUR*                             | USD     | 0,026774  | 0,028056 | 0,027238  | 0,032112  | 0,032304  | 0,031800  | 0,033765  | 0,035496  | 0,034110  | 0,036111  | 0,037719  | 0,037795  |
| PM3H GBP*                             | USD     | 0,043399  | 0,044889 | 0,045722  | 0,054415  | 0,054293  | 0,052515  | 0,052401  | 0,054236  | 0,054005  | 0,056820  | 0,057393  | 0,057178  |
| PM3H RMB*                             | USD     | 0,002426  | 0,002819 | 0,002779  | 0,002824  | 0,002476  | 0,003363  | 0,004772  | 0,004331  | 0,002885  | 0,003204  | 0,003607  | 0,003517  |
| PM3H SGD*                             | USD     | 0,024117  | 0,022528 | 0,022615  | 0,024541  | 0,022805  | 0,021555  | 0,022108  | 0,022996  | 0,023237  | 0,024812  | 0,023525  | 0,023589  |
| UM2                                   | USD     | 0,044403  | 0,044377 | 0,044394  | 0,046990  | 0,046981  | 0,047033  | 0,047044  | 0,047056  | 0,047127  | 0,049789  | 0,049777  | 0,049777  |
| UM2 HKD*                              | USD     | 0,005661  | 0,005658 | 0,005660  | 0,005999  | 0,005988  | 0,005991  | 0,005996  | 0,005993  | 0,006010  | 0,006345  | 0,006343  | 0,006344  |
| ZM*                                   | USD     | 0,030378  | 0,044555 | 0,039475  | 0,044152  | 0,041077  | 0,036739  | 0,043528  | 0,045927  | 0,031579  | 0,057260  | 0,042173  | 0,040668  |
| <b>US Dollar Bond</b>                 |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| AD                                    | USD     | -         | 0,195597 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| AM2                                   | USD     | 0,034338  | 0,033258 | 0,033442  | 0,032048  | 0,031324  | 0,030750  | 0,029964  | 0,031077  | 0,032209  | 0,034508  | 0,034001  | 0,034125  |
| AM2 HKD*                              | USD     | 0,043953  | 0,042575 | 0,042805  | 0,041083  | 0,040083  | 0,039333  | 0,038362  | 0,039739  | 0,041235  | 0,044149  | 0,043505  | 0,043664  |

\* Die in der Erläuterung angegebenen Dividendensätze sind in der Währung des Teilfonds unter Verwendung des maßgeblichen Wechselkurses am Stichtag der jeweiligen Ausschüttung angegeben.

# Erläuterungen zum Abschluss

## für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

### 9. Dividenden (Fortsetzung)

| Teilfonds   | Währung | Apr. 2023 | Mai 2023 | Jun. 2023 | Jul. 2023 | Aug. 2023 | Sep. 2023 | Okt. 2023 | Nov. 2023 | Dez. 2023 | Jan. 2024 | Feb. 2024 | Mär. 2024 |
|---|---------|-----------|----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| <b>US Dollar Bond (Fortsetzung)</b>   |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| AM3H CAD*   | USD     | -         | -        | -         | -         | -         | -         | -         | -         | 0,027018  | 0,028787  | 0,028851  | 0,028553  |
| AM3H EUR*   | USD     | -         | -        | -         | -         | -         | -         | -         | -         | 0,028376  | 0,031010  | 0,032191  | 0,032384  |
| AM3H GBP*   | USD     | -         | -        | -         | -         | -         | -         | -         | -         | 0,048514  | 0,051803  | 0,051652  | 0,051626  |
| ID  | USD     | -         | 0,347266 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| PD  | USD     | -         | 0,221277 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| WD  | USD     | -         | 0,298836 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ZD  | USD     | -         | 0,294377 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| <b>US High Yield Bond</b>   |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| AM2   | USD     | 0,062082  | 0,055838 | 0,056048  | 0,054162  | 0,053558  | 0,052906  | 0,051572  | 0,053397  | 0,055012  | 0,054121  | 0,053721  | 0,053827  |
| AM2 HKD*  | USD     | 0,007910  | 0,007116 | 0,007142  | 0,006911  | 0,006823  | 0,006737  | 0,006572  | 0,006798  | 0,007071  | 0,006893  | 0,006842  | 0,006856  |
| AM3H AUD*   | USD     | 0,033607  | 0,028863 | 0,030289  | 0,031115  | 0,028493  | 0,027304  | 0,026733  | 0,029026  | 0,031470  | 0,029652  | 0,028699  | 0,029058  |
| AM3H RMB*   | USD     | 0,005794  | 0,005058 | 0,005154  | 0,004660  | 0,004280  | 0,004944  | 0,005920  | 0,005833  | 0,004783  | 0,004632  | 0,004924  | 0,004850  |
| AQ1   | USD     | -         | -        | 0,127428  | -         | -         | -         | 0,143766  | -         | 0,138929  | -         | -         | 0,144408  |
| IQ1   | USD     | -         | -        | 0,131292  | -         | -         | -         | 0,148553  | -         | 0,144109  | -         | -         | 0,150169  |
| XQ1   | USD     | -         | -        | 0,131580  | -         | -         | -         | 0,148928  | -         | 0,144477  | -         | -         | 0,150620  |
| ZD  | USD     | -         | 0,585562 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ZQ1   | USD     | -         | -        | 0,134237  | -         | -         | -         | 0,152240  | -         | 0,148074  | -         | -         | 0,154635  |
| <b>US Short Duration High Yield Bond*</b>   |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| AD  | USD     | -         | 0,447489 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ADH EUR*  | USD     | -         | 0,401579 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ED  | USD     | -         | 0,404634 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| ZQ1   | USD     | -         | -        | 0,123923  | -         | -         | 0,150328  | -         | -         | 0,142935  | -         | -         | 0,159865  |
| ZQ1H CHF*   | USD     | -         | -        | 0,116094  | -         | -         | 0,142170  | -         | -         | 0,131894  | -         | -         | 0,150046  |
| ZQ1H EUR*   | USD     | -         | -        | 0,116940  | -         | -         | 0,141507  | -         | -         | 0,131144  | -         | -         | 0,148532  |
| ZQ1H GBP*   | USD     | -         | -        | 0,143982  | -         | -         | 0,177046  | -         | -         | 0,163288  | -         | -         | 0,187691  |
| ZQ1H SGD*   | USD     | -         | -        | 0,088956  | -         | -         | 0,106661  | -         | -         | 0,100249  | -         | -         | 0,113157  |
| <b>Global Credit Floating Rate Fixed Term Bond 2023 – 1 (geschlossen zum 5. Juli 2023)</b>      |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| AM2   | USD     | 0,053565  | 0,053565 | 0,053565  | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| AM3H EUR*   | USD     | 0,036992  | 0,038041 | 0,038714  | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| AM3H SGD*   | USD     | 0,031789  | 0,030121 | 0,030352  | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| BM2   | USD     | 0,054982  | 0,054982 | 0,054982  | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| BM3H EUR*   | USD     | 0,038552  | 0,039562 | 0,040260  | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| BM3H GBP*   | USD     | 0,057962  | 0,059430 | 0,060794  | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| PM2   | USD     | 0,054232  | 0,054232 | 0,054232  | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| PM3H GBP*   | USD     | 0,057027  | 0,058499 | 0,059841  | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| PM3H RMB*   | USD     | 0,003995  | 0,004159 | 0,004296  | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| <b>Global Credit Floating Rate Fixed Term Bond 2023 – 2 (geschlossen zum 29. Dezember 2023)</b> |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| AM2   | USD     | 0,053169  | 0,053169 | 0,056882  | 0,056882  | 0,056882  | 0,056882  | 0,055477  | 0,055281  | 0,055352  | -         | -         | -         |
| AM3H EUR*   | USD     | 0,036557  | 0,037618 | 0,042334  | 0,044602  | 0,044545  | 0,043723  | 0,044242  | 0,046072  | 0,046896  | -         | -         | -         |
| AM3H SGD*   | USD     | 0,031493  | 0,029829 | 0,032803  | 0,033108  | 0,031211  | 0,029948  | 0,029518  | 0,030429  | 0,030760  | -         | -         | -         |
| BM2   | USD     | 0,054586  | 0,054586 | 0,058299  | 0,058299  | 0,058299  | 0,058299  | 0,056890  | 0,056697  | 0,056768  | -         | -         | -         |
| BM3H GBP*   | USD     | 0,057468  | 0,058938 | 0,065010  | 0,070904  | 0,070375  | 0,068210  | 0,066399  | 0,068628  | 0,069206  | -         | -         | -         |
| PM2   | USD     | 0,053836  | 0,053836 | 0,057549  | 0,057549  | 0,057549  | 0,057549  | 0,056144  | 0,055947  | 0,056018  | -         | -         | -         |
| PM2 HKD*  | USD     | 0,006858  | 0,006872 | 0,007349  | 0,007377  | 0,007333  | 0,007357  | 0,007178  | 0,007168  | 0,007168  | -         | -         | -         |
| PM3H AUD*   | USD     | 0,027142  | 0,026254 | 0,030135  | 0,032722  | 0,030150  | 0,029103  | 0,028413  | 0,029749  | 0,030822  | -         | -         | -         |
| <b>Global Emerging Markets Multi-Asset Income</b>   |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| AM2   | USD     | 0,039669  | 0,038885 | 0,039714  | 0,038370  | 0,037170  | 0,036505  | 0,035629  | 0,037273  | 0,038067  | 0,037866  | 0,038095  | 0,038057  |
| AM2 HKD*  | USD     | 0,005074  | 0,004974 | 0,005077  | 0,004914  | 0,004753  | 0,004666  | 0,004558  | 0,004763  | 0,004866  | 0,004841  | 0,004870  | 0,004866  |
| AM30 AUD*   | USD     | 0,019693  | 0,018686 | 0,020069  | 0,020917  | 0,018609  | 0,017589  | 0,017298  | 0,019300  | 0,020556  | 0,019663  | 0,019231  | 0,019426  |
| AM30 EUR*   | USD     | 0,027673  | 0,027777 | 0,028876  | 0,028890  | 0,027981  | 0,026976  | 0,027608  | 0,030216  | 0,029941  | 0,029132  | 0,030407  | 0,030423  |
| AM30 GBP*   | USD     | 0,041073  | 0,041233 | 0,043080  | 0,045394  | 0,043712  | 0,041610  | 0,040538  | 0,043952  | 0,044712  | 0,044059  | 0,044718  | 0,044514  |
| AM30 RMB*   | USD     | 0,003096  | 0,003145 | 0,003307  | 0,002900  | 0,002549  | 0,003124  | 0,004004  | 0,003899  | 0,002919  | 0,002920  | 0,003207  | 0,003135  |
| AM30 SGD*   | USD     | 0,026636  | 0,024803 | 0,025522  | 0,024565  | 0,022363  | 0,021028  | 0,020957  | 0,022709  | 0,023400  | 0,022985  | 0,022087  | 0,022131  |
| <b>Managed Solutions – Asia Focused Conservative</b>  |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| AM2   | USD     | 0,046524  | 0,045628 | 0,046117  | 0,041858  | 0,040446  | 0,040101  | 0,039293  | 0,040597  | 0,041310  | 0,041580  | 0,041756  | 0,041909  |
| AM2 HKD*  | USD     | 0,005999  | 0,005884 | 0,005944  | 0,005405  | 0,005213  | 0,005167  | 0,005067  | 0,005230  | 0,005327  | 0,005359  | 0,005381  | 0,005402  |
| AM30 RMB*   | USD     | 0,003176  | 0,003261 | 0,003422  | 0,002625  | 0,002242  | 0,002967  | 0,004053  | 0,003824  | 0,002639  | 0,002665  | 0,003020  | 0,002954  |
| <b>Managed Solutions – Asia Focused Growth</b>  |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| AM2   | USD     | 0,026611  | 0,026516 | 0,027281  | 0,025076  | 0,023647  | 0,023235  | 0,022418  | 0,023563  | 0,023704  | 0,023832  | 0,024648  | 0,024928  |
| <b>Managed Solutions – Asia Focused Income</b>  |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| AM2   | USD     | 0,041521  | 0,040608 | 0,041344  | 0,038168  | 0,036888  | 0,036566  | 0,035598  | 0,036935  | 0,037563  | 0,036152  | 0,036532  | 0,036920  |
| AM2 HKD*  | USD     | 0,005347  | 0,005230 | 0,005322  | 0,004923  | 0,004750  | 0,004706  | 0,004586  | 0,004752  | 0,004838  | 0,004654  | 0,004703  | 0,004753  |
| AM30 AUD*   | USD     | 0,017943  | 0,016942 | 0,018121  | 0,018178  | 0,016023  | 0,015191  | 0,014849  | 0,016351  | 0,017658  | 0,016171  | 0,015829  | 0,016193  |
| AM30 CAD*   | USD     | -         | -        | -         | -         | -         | -         | -         | -         | 0,032828  | 0,030937  | 0,031734  | 0,031656  |
| AM30 EUR*   | USD     | 0,024356  | 0,024604 | 0,025504  | 0,024089  | 0,023388  | 0,022787  | 0,023480  | 0,025554  | 0,024997  | 0,023105  | 0,024475  | 0,024787  |
| AM30 GBP*   | USD     | -         | -        | -         | -         | -         | -         | -         | -         | 0,058313  | 0,055459  | 0,056650  | 0,057030  |
| AM30 RMB*   | USD     | 0,002639  | 0,002708 | 0,002868  | 0,002270  | 0,001940  | 0,002567  | 0,003482  | 0,003300  | 0,002276  | 0,002093  | 0,002414  | 0,002373  |
| AM30 SGD*   | USD     | 0,021963  | 0,020282 | 0,020835  | 0,018891  | 0,017008  | 0,016035  | 0,016001  | 0,017244  | 0,017690  | 0,016509  | 0,015761  | 0,015973  |
| <b>Multi-Strategy Target Return</b>   |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| ID  | USD     | -         | 0,134740 | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         | -         |
| <b>US Income Focused</b>  |         |           |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |
| AM2   | USD     | 0,045634  | 0,045080 | 0,045804  | 0,043558  | 0,042079  | 0,041465  | 0,040089  | 0,042502  | 0,044078  | 0,043482  | 0,043687  | 0,044258  |
| AM2 HKD*  | USD     | 0,005872  | 0,005802 | 0,005895  | 0,005614  | 0,005413  | 0,005332  | 0,005160  | 0,005464  | 0,005669  | 0,005593  | 0,005619  | 0,005693  |
| AM3H AUD*   | USD     | 0,021931  | 0,020916 | 0,022442  | 0,023075  | 0,023011  | 0,019126  | 0,018695  | 0,020890  | 0,023014  | 0,021655  | 0,021072  | 0,021610  |
| AM3H CAD*   | USD     | 0,029574  | 0,028789 | 0,029593  | 0,029209  | 0,027542  | 0,027415  | 0,025762  | 0,028044  | 0,029081  | 0,028121  | 0,028687  | 0,028881  |
| AM3H EUR*   | USD     | 0,029967  | 0,030616 | 0,031663  | 0,030729  | 0,029792  | 0,028851  | 0,029563  | 0,032879  | 0,032757  | 0,031153  | 0,032826  | 0,033327  |
| AM3H GBP*   | USD     | 0,046435  | 0,047189 | 0,049042  | 0,051219  | 0,049350  | 0,047158  | 0,045515  | 0,049829  | 0,051472  | 0,050202  | 0,050893  | 0,051461  |
| AM3H RMB*   | USD     | 0,003096  | 0,003215 | 0,003403  | 0,002747  | 0,002338  | 0,003105  | 0,004219  | 0,004074  | 0,002833  | 0,002696  | 0,003097  | 0,003052  |

\* Die in der Erläuterung angegebenen Dividendensätze sind in der Währung des Teilfonds unter Verwendung des maßgeblichen Wechselkurses am Stichtag der jeweiligen Ausschüttung angegeben.

\*\* Bis zum 2. Juli 2023 lautete der Name des Teilfonds „Global Short Duration High Yield Bond“.

# Erläuterungen zum Abschluss

## für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

### 10. Sonstige Erträge

Die sonstigen Erträge bestehen überwiegend aus Verwässerungsabgaben (siehe Erläuterung 14).

### 11. Wertpapierleihe

Jeder Teilfonds kann zum Zwecke der Generierung von zusätzlichem Kapital oder Erträgen (entweder durch die von den Leihnehmern gezahlte Gebühr oder die Wiederanlage der Barsicherheiten) oder zur Senkung der Kosten Wertpapierleihgeschäfte tätigen, sofern diese den Bestimmungen in Verordnung (EU) 2015/2365 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 25. November 2015 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und der Weiterverwendung („SFT-Verordnung“), den ESMA-Leitlinien vom 1. August 2014 über ETF und andere OGAW-Themen (ESMA/2014/937EN) (die „Leitlinien zu börsengehandelten Indexfonds (Exchange-Traded Funds, ETF) und anderen OGAW-Themen“), dem CSSF-Rundschreiben 08/356 in Bezug auf Vorschriften für Organismen für gemeinsame Anlagen, wenn sie bestimmte Techniken und Instrumente in Bezug auf übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente einsetzen und CSSF-Rundschreiben 14/592 in Bezug auf die ESMA-Leitlinien zu ETF und anderen OGAW-Themen (das „CSSF-Rundschreiben 14/592“) und allen anderen geltenden Gesetzen, Vorschriften, Rundschreiben oder CSSF-Positionen in ihrer jeweils gültigen Fassung entsprechen.

Der Verwaltungsrat hat die Durchführung, Verwaltung und laufende Überwachung eines Wertpapierleihprogramms an die Verwaltungsgesellschaft delegiert. Die Verwaltungsgesellschaft kann entscheiden, welcher Teilfonds Wertpapierleihgeschäfte eingehen soll, bei denen Wertpapiere gegen Sicherheiten vorübergehend an von der Verwaltungsgesellschaft genehmigte Leihnehmer übertragen werden. Alle übertragbaren Wertpapiere oder Geldmarktinstrumente, die zu einem Teilfonds gehören, können Gegenstand von Wertpapierleihgeschäften sein. Die Verwaltungsgesellschaft erstattet dem Verwaltungsrat regelmäßig Bericht über die Wertpapierleihgeschäfte und unterliegt in Bezug auf das Wertpapierleihprogramm der laufenden Aufsicht und Kontrolle durch den Verwaltungsrat.

Ziel ist es, Wertpapierleihgeschäfte fortlaufend zu nutzen. Der Anteil des Nettovermögens des Teilfonds, der Gegenstand von Wertpapierleihgeschäften ist, sollte etwa 25 % betragen.

Die Wertpapierleihstelle erhält für ihre Dienstleistungen im Zusammenhang mit Wertpapierleihgeschäften eine Gebühr in Höhe von 15 % der Bruttoerträge und die Verwaltungsgesellschaft eine Gebühr in Höhe von 10 % der Bruttoerträge für die im Zusammenhang mit dem Wertpapierleihgeschäft geleistete Beaufsichtigungsarbeit. Der restliche Bruttoertrag (75 %) geht an den entsprechenden Teilfonds, der das Wertpapierleihgeschäft tätigt. Die Angaben zu Rendite und Kosten nach Teilfonds sind in Anhang VII (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte („SFT-Verordnung“) auf den Seiten 545 bis 573 aufgeführt.

Das Genehmigungs- und Auswahlverfahren für Kontrahenten von Wertpapierleihgeschäften stellt eine dynamische Beurteilung der Kontrahenten auf Basis mehrerer Kriterien dar. Zu den Kriterien, die für die Zulassung von Kontrahenten herangezogen werden, gehören unter anderem ein Mindestkreditrating des Kontrahenten, das Herkunftsland, die Verfügbarkeit, die Ausführung von Spezialgeschäften und das regulatorische Risikoprofil.

| Teilfonds                                  | Währung | Marktwert der verliehenen Wertpapiere | Marktwert der erhaltenen Sicherheiten | Gewinn aus Wertpapierleihen (netto)* |
|--|---------|---------------------------------------|---------------------------------------|--------------------------------------|
| ASEAN Equity *                             | USD     | -                                     | -                                     | 9.903                                |
| Asia ex Japan Equity                       | USD     | 6.462.281                             | 6.850.698                             | 25.859                               |
| Asia ex Japan Equity Smaller Companies     | USD     | 62.639.255                            | 66.060.102                            | 896.675                              |
| Asia Pacific ex Japan Equity High Dividend | USD     | 9.627.050                             | 10.206.897                            | 60.995                               |
| Chinese Equity                             | USD     | 10.168.371                            | 11.196.695                            | 57.475                               |
| Euroland Equity Smaller Companies          | EUR     | 15.940.021                            | 16.845.550                            | 31.159                               |
| Euroland Growth                            | EUR     | 24.079.718                            | 25.505.577                            | 28.118                               |
| Euroland Value                             | EUR     | 42.897.752                            | 45.378.272                            | 36.216                               |
| Europe Value                               | EUR     | 11.808.589                            | 13.327.353                            | 32.270                               |
| Global Emerging Markets Equity             | USD     | 18.819.331                            | 21.063.616                            | 90.498                               |
| Global Infrastructure Equity               | USD     | 69.872.221                            | 73.686.890                            | 108.774                              |
| Global Sustainable Long Term Dividend      | USD     | 4.340.365                             | 4.602.159                             | 3.558                                |
| Global Lower Carbon Equity                 | USD     | 13.670.827                            | 14.550.056                            | 11.587                               |
| Hong Kong Equity                           | USD     | -                                     | 249.806                               | 12.229                               |
| BRIC Equity                                | USD     | 1.218.881                             | 1.293.079                             | 6.750                                |
| BRIC Markets Equity                        | USD     | 399.071                               | 414.358                               | 1.508                                |
| Frontier Markets                           | USD     | 406.280                               | 422.491                               | 637                                  |
| Global Equity Volatility Focused           | USD     | 11.905.905                            | 12.593.030                            | 147.700                              |
| Global Real Estate Equity                  | USD     | 88.996.115                            | 93.768.709                            | 148.639                              |
| Brazil Equity                              | USD     | -                                     | -                                     | 9                                    |
| Economic Scale US Equity                   | USD     | 39.020.085                            | 41.097.986                            | 278.541                              |
| Indian Equity                              | USD     | 6.312.776                             | 6.690.904                             | 24.174                               |
| Turkey Equity                              | EUR     | -                                     | -                                     | 11.250                               |

^ Bis zum 31. Juli 2023 lautete der Name des Teilfonds „Thai Equity“.



# Erläuterungen zum Abschluss

für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## 11. Wertpapierleihe (Fortsetzung)

| Teilfonds  | Währung | Marktwert der verliehenen Wertpapiere | Marktwert der erhaltenen Sicherheiten | Gewinn aus Wertpapierleihen (netto)* |
|--|---------|---------------------------------------|---------------------------------------|--------------------------------------|
| Asia Bond  | USD     | 75.206.237                            | 80.422.555                            | 605.188                              |
| Asia High Yield Bond   | USD     | 131.286.962                           | 142.176.179                           | 2.523.801                            |
| Euro Bond  | EUR     | 2.523.263                             | 3.085.833                             | 19.135                               |
| Euro Bond Total Return   | EUR     | 10.667.898                            | 12.269.306                            | 15.740                               |
| Euro Credit Bond   | EUR     | 48.369.122                            | 57.333.490                            | 52.044                               |
| Euro High Yield Bond   | EUR     | 133.690.523                           | 143.440.035                           | 414.957                              |
| GEM Debt Total Return  | USD     | 1.277.728                             | 1.641.241                             | 6.296                                |
| Global Bond Total Return   | USD     | 13.475.569                            | 16.024.211                            | 27.216                               |
| Global Corporate Bond  | USD     | 574.321.709                           | 621.490.701                           | 610.459                              |
| Global Emerging Markets Bond   | USD     | 118.144.317                           | 127.267.175                           | 221.381                              |
| Global Emerging Markets Local Debt   | USD     | 158.830.524                           | 171.506.430                           | 216.546                              |
| Global Government Bond   | USD     | 964.878.793                           | 1.043.878.015                         | 991.833                              |
| Global High Income Bond  | USD     | 168.141.235                           | 180.146.296                           | 179.957                              |
| Global High Yield Bond   | USD     | 141.324.055                           | 149.842.531                           | 577.714                              |
| Global Inflation Linked Bond   | USD     | 115.689.297                           | 126.931.026                           | 66.670                               |
| Global Investment Grade Securitised Credit Bond  | USD     | -                                     | -                                     | 176                                  |
| Global Short Duration Bond   | USD     | 266.829.572                           | 283.198.871                           | 216.546                              |
| US Short Duration High Yield Bond**  | USD     | 13.786.943                            | 14.419.025                            | 32.949                               |
| RMB Fixed Income   | USD     | 2.414.721                             | 3.153.981                             | 44.294                               |
| Singapore Dollar Income Bond   | SGD     | 25.521.992                            | 26.683.307                            | 114.880                              |
| Ultra Short Duration Bond  | USD     | 44.792.822                            | 47.089.433                            | 344                                  |
| US Dollar Bond   | USD     | 9.900.058                             | 10.385.294                            | 6.386                                |
| US High Yield Bond   | USD     | 2.139.079                             | 2.668.797                             | 2.410                                |
| Global Credit Floating Rate Fixed Term Bond 2023 – 1 (geschlossen zum 5. Juli 2023)      | USD     | -                                     | -                                     | 16.286                               |
| Global Credit Floating Rate Fixed Term Bond 2023 – 2 (geschlossen zum 29. Dezember 2023) | USD     | -                                     | -                                     | 22.773                               |
| Global Emerging Markets Multi-Asset Income   | USD     | -                                     | -                                     | 154                                  |
| Managed Solutions – Asia Focused Conservative  | USD     | 300.776                               | 316.092                               | 927                                  |
| Multi-Asset Style Factors  | EUR     | 70.576.146                            | 77.648.253                            | 15.244                               |
| Managed Solutions – Asia Focused Growth  | USD     | -                                     | -                                     | 220                                  |
| Managed Solutions – Asia Focused Income  | USD     | 16.909.763                            | 17.950.138                            | 255.686                              |
| Multi-Strategy Target Return   | EUR     | -                                     | -                                     | 2.889                                |
| US Income Focused  | USD     | 21.252.030                            | 22.129.739                            | 22.370                               |

\*\* Bis zum 2. Juli 2023 lautete der Name des Teilfonds „Global Short Duration High Yield Bond“.

\* Alle Erträge (abzüglich Transaktionskosten) aus Wertpapierleihgeschäften fließen dem jeweiligen Teilfonds zu und sind in der Position „Anlageerträge, netto“ in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und den Änderungen des Nettovermögens enthalten. Die Gesamtsumme der Bruttoerträge nach Teilfonds ist in Anhang VII (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte („SFT-Verordnung“) im Abschnitt „Rendite und Kosten“ des aktuellen Berichts aufgeführt.

Die Wertpapierleihstelle ist The Hong Kong and Shanghai Banking Corporation Limited, ein verbundenes Unternehmen der Verwaltungsgesellschaft.

Die im Rahmen des Wertpapierleihgeschäfts erhaltenen Sicherheiten entsprechen Anleihen und Aktien.

Die Namen der einzelnen Kontrahenten nach Teilfonds sind in Anhang VII (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte („SFT-Verordnung“) im Abschnitt in „Angaben zur Konzentration“ auf den Seiten 547 bis 556 des aktuellen Berichts aufgeführt.

Während des Geschäftsjahres zum 31. März 2024 gab es keine Wiederverwendung von Sicherheiten im Rahmen von Wertpapierleihgeschäften.

# Erläuterungen zum Abschluss

## für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

### 12. Transaktionen mit verbundenen Personen und Ausgleichsprovisionen eines jeden Teilfonds

Sämtliche Transaktionen mit verbundenen Parteien wurden auf rein geschäftlicher Basis durchgeführt.

#### (a) Bankkonten und Einlagen bei verbundenen Parteien

Bankkonten und Einlagen werden hauptsächlich bei HSBC Continental Europe, einem Mitglied der HSBC-Gruppe, eingerichtet bzw. getätigt.

#### (b) Anlagentransaktionen mit verbundenen Parteien

Beim Kauf und Verkauf von Anlagen verwenden die Teilfonds die Dienste von Mitgliedern der HSBC-Gruppe. Einzelheiten solcher während des zum 31. März 2024 endenden Geschäftsjahres getätigter Transaktionen sind weiter unten dargestellt.

| Teilfonds  | Währung | Gesamtwert solcher Transaktionen für das Geschäftsjahr | Prozentsatz des Wertes solcher Transaktionen zu den gesamten Transaktionen für das Geschäftsjahr (%) | Gezahlte Provisionen während des Geschäftsjahres | Durchschnittlicher Provisionssatz (%) |
|--|---------|--|--|--|---------------------------------------|
| Asia ex Japan Equity   | USD     | 3.649.013  | 0,39 %   | 4.895  | 0,13 %                                |
| Asia ex Japan Equity Smaller Companies   | USD     | 26.256.835   | 1,25 %   | 39.313   | 0,15 %                                |
| Asia Pacific ex Japan Equity High Dividend                                       | USD     | 11.734.969   | 1,68 %   | 15.122   | 0,13 %                                |
| China A-Shares Equity  | USD     | 15.806.658   | 9,85 %   | -  | 0,00 %                                |
| Chinese Equity   | USD     | 87.777.859   | 6,05 %   | 7.514  | 0,01 %                                |
| Euroland Growth  | EUR     | 5.255.593  | 1,98 %   | 827  | 0,02 %                                |
| Europe Value   | EUR     | 912.920  | 1,80 %   | 228  | 0,02 %                                |
| Global Emerging Markets Equity   | USD     | 35.407.160   | 6,12 %   | 15.089   | 0,04 %                                |
| Global Lower Carbon Equity   | USD     | 16.936.425   | 2,63 %   | 332  | 0,00 %                                |
| Global Sustainable Equity Income   | USD     | 45.104.969   | 13,55 %  | 5.054  | 0,01 %                                |
| Global Sustainable Long Term Dividend  | USD     | 2.215.703  | 1,81 %   | 647  | 0,03 %                                |
| Hong Kong Equity   | USD     | 31.274.072   | 11,75 %  | 8.668  | 0,03 %                                |
| BRIC Equity  | USD     | 769.432  | 0,97 %   | 415  | 0,05 %                                |
| BRIC Markets Equity  | USD     | 170.250  | 0,58 %   | 119  | 0,07 %                                |
| Frontier Markets   | USD     | 73.724.701   | 13,77 %  | 148.105  | 0,20 %                                |
| Economic Scale US Equity   | USD     | 31.321.642   | 12,06 %  | 1.892  | 0,01 %                                |
| Indian Equity  | USD     | 33.362.650   | 2,82 %   | 45.213   | 0,14 %                                |
| Turkey Equity  | EUR     | 2.468.519  | 0,80 %   | -  | 0,00 %                                |
| Asia Bond  | USD     | 92.480.395   | 5,08 %   | -  | 0,00 %                                |
| Asia ESG Bond  | USD     | 6.472.892  | 6,99 %   | -  | 0,00 %                                |
| Asia High Yield Bond   | USD     | 216.212.422  | 3,78 %   | -  | 0,00 %                                |
| Asian Currencies Bond  | USD     | 4.518.022  | 7,72 %   | -  | 0,00 %                                |
| Corporate Euro Bond Fixed Term 2027  | EUR     | 7.759.040  | 4,31 %   | -  | 0,00 %                                |
| Euro Bond  | EUR     | 8.402.241  | 20,84 %  | -  | 0,00 %                                |
| Euro Bond Total Return   | EUR     | 94.778.057   | 6,96 %   | -  | 0,00 %                                |
| Euro Credit Bond   | EUR     | 225.516.222  | 6,43 %   | -  | 0,00 %                                |
| Euro High Yield Bond   | EUR     | 120.218.237  | 12,93 %  | -  | 0,00 %                                |
| GEM Debt Total Return  | USD     | 18.565.670   | 1,22 %   | -  | 0,00 %                                |
| Global Bond  | USD     | 44.394.405   | 12,58 %  | -  | 0,00 %                                |
| Global Bond Total Return   | USD     | 862.738.125  | 25,16 %  | -  | 0,00 %                                |
| Global Emerging Markets Corporate Sustainable Bond (aufgelegt zum 30. Juni 2023) | USD     | 12.447.453   | 7,44 %   | -  | 0,00 %                                |
| Global ESG Corporate Bond  | USD     | 95.209.958   | 15,50 %  | -  | 0,00 %                                |
| Global Government Bond   | USD     | 2.169.429.075  | 15,13 %  | -  | 0,00 %                                |
| Global Green Bond  | USD     | 1.521.498  | 1,50 %   | -  | 0,00 %                                |
| Global High Income Bond  | USD     | 68.934.254   | 1,48 %   | -  | 0,00 %                                |
| Global High Yield Bond   | USD     | 11.666.271   | 0,41 %   | -  | 0,00 %                                |
| Global High Yield ESG Bond   | USD     | 1.518.301  | 1,63 %   | -  | 0,00 %                                |
| Global High Yield Securitised Credit Bond  | USD     | 9.315.315  | 4,36 %   | -  | 0,00 %                                |
| Global Inflation Linked Bond   | USD     | 198.942.097  | 15,52 %  | -  | 0,00 %                                |
| Global Investment Grade Securitised Credit Bond                                  | USD     | 262.317.002  | 5,24 %   | -  | 0,00 %                                |
| Global Lower Carbon Bond   | USD     | 110.319.414  | 13,72 %  | -  | 0,00 %                                |
| Global Securitised Credit Bond   | USD     | 11.130.533   | 15,18 %  | -  | 0,00 %                                |
| Global Short Duration Bond   | USD     | 3.904.277.970  | 24,47 %  | -  | 0,00 %                                |
| India Fixed Income   | USD     | 166.905.217  | 11,89 %  | -  | 0,00 %                                |
| RMB Fixed Income   | USD     | 86.747.147   | 20,85 %  | -  | 0,00 %                                |
| Singapore Dollar Income Bond   | SGD     | 40.769.366   | 4,33 %   | -  | 0,00 %                                |
| US Short Duration High Yield Bond*   | USD     | 2.553.789  | 1,18 %   | -  | 0,00 %                                |
| Global Emerging Markets Multi-Asset Income                                       | USD     | 13.551.171   | 7,50 %   | 3.829  | 0,03 %                                |
| Managed Solutions – Asia Focused Conservative                                    | USD     | 36.938.488   | 31,70 %  | -  | 0,00 %                                |
| Managed Solutions – Asia Focused Growth  | USD     | 8.017.615  | 11,84 %  | 244  | 0,00 %                                |
| Managed Solutions – Asia Focused Income  | USD     | 91.748.399   | 10,21 %  | 6.080  | 0,01 %                                |
| Multi-Asset Style Factors  | EUR     | 12.440.283.994   | 35,88 %  | -  | 0,00 %                                |
| Multi-Strategy Target Return   | EUR     | 1.839.611.332  | 48,85 %  | 106  | 0,00 %                                |
| US Income Focused  | USD     | 89.760.415   | 4,55 %   | 7.878  | 0,01 %                                |
| Euroland Value   | EUR     | 13.986.501   | 5,19 %   | 933  | 0,01 %                                |
| Global Equity Climate Change   | USD     | 297.476  | 0,23 %   | 119  | 0,04 %                                |
| Global Infrastructure Equity   | USD     | 1.309.822  | 0,18 %   | 917  | 0,07 %                                |
| Global Sustainable Long Term Equity  | USD     | 27.293   | 0,03 %   | 8  | 0,03 %                                |
| Global Corporate Bond  | USD     | 428.517.530  | 3,46 %   | -  | 0,00 %                                |
| Global Emerging Markets ESG Bond   | USD     | 223.906  | 0,04 %   | -  | 0,00 %                                |
| Ultra Short Duration Bond  | USD     | 5.000.000  | 0,20 %   | -  | 0,00 %                                |

\* Bis zum 2. Juli 2023 lautete der Name des Teilfonds „Global Short Duration High Yield Bond“.

# Erläuterungen zum Abschluss

## für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

### 12. Transaktionen mit verbundenen Personen und Ausgleichsprovisionen eines jeden Teilfonds (Fortsetzung)

#### (b) Anlagetransaktionen mit verbundenen Parteien (Fortsetzung)

Es bestehen keine Soft-Commission-Vereinbarungen, mit Ausnahme der nachstehend ausführlich beschriebenen Provisionsteilungsvereinbarungen.

An manchen Standorten haben der Anlageberater und die mit ihm verbundenen Personen für bestimmte, dem Anlageberater oder den mit ihm verbundenen Personen zur Verfügung gestellte Gegenstände und Dienstleistungen, die die Anlageentscheidungen unterstützen, Provisionsteilungsvereinbarungen mit bestimmten Maklern abgeschlossen (ausschließlich in Bezug auf vom Fonds genutzte Research-Dienste, die von der Hong Kong Securities and Futures Commission als Soft Commissions bezeichnet werden).

Der Anlageberater oder die mit ihm verbundenen Personen entrichten für diese Leistungen keine direkten Zahlungen, sondern tätigen und vereinbaren in einem gewissen Umfang mit den Maklern im Namen der jeweiligen Teilfonds Geschäfte. Alle Transaktionen wurden im Rahmen der üblichen Geschäftstätigkeit und zu normalen Geschäftsbedingungen abgewickelt.

Die Gesellschaft bezahlte für diese Transaktionen Provisionen. Die der Gesellschaft zur Verfügung gestellten Güter und Leistungen umfassen Folgendes: Research- und Beratungsdienste, Wirtschafts- und politische Analyse, Portfolioanalysen, Marktanalysen und anlagebezogene Publikationen.

#### (c) Von Verwaltungsratsmitgliedern gehaltene Gesellschaftsanteile

Timothy Palmer erwarb vor seiner Ernennung zum Verwaltungsratsmitglied der Gesellschaft Anteile am HGIF Turkey Equity und hält diese.

### 13. Liste der Veränderungen des Portfolios

Eine Liste sämtlicher Veränderungen des Portfolios ist auf Anfrage am Sitz der Gesellschaft kostenlos erhältlich.

### 14. Antiverwässerungsmechanismen

Es stehen für jeden Teilfonds zwei Antiverwässerungsmechanismen zur Verfügung, eine Preisanpassung und eine Antiverwässerungsgebühr, die beide darauf abzielen, die Anteilinhaber eines Teilfonds zu schützen. Es gibt zwei verschiedene Preisanpassungsmechanismen: Eine partielle Swing-Pricing-Anpassung und eine vollständige Swing-Pricing-Anpassung (die nur für den Teilfonds Corporate Euro Bond Fixed Term 2027 gilt).

Wenn Anleger Anteile an einem Teilfonds kaufen oder verkaufen, kann es erforderlich werden, dass der Anlageberater die zugrunde liegenden Anlagen innerhalb des Teilfonds kauft oder verkauft. Ohne einen Antiverwässerungsmechanismus zur Berücksichtigung dieser Transaktionen würden alle Anteilinhaber des Teilfonds die damit verbundenen Kosten für den Kauf und Verkauf dieser zugrunde liegenden Anlagen tragen. Diese Transaktionskosten können insbesondere Geld-Brief-Spannen, Maklergebühren und Transaktionssteuern umfassen.

#### *Antiverwässerungsgebühr*

Bis zum Erreichen des Schwellenwerts des Antiverwässerungsmechanismus wird keine Antiverwässerungsgebühr erhoben oder Preisanpassung vorgenommen und die Transaktionskosten werden vom Teilfonds getragen. Dies wird für bestehende Anteilinhaber eine Verwässerung (Verringerung des Nettoinventarwerts je Anteil) zur Folge haben. Anleger sollten beachten, dass Untervertriebsstellen den Ausgabeaufschlag (sofern vorhanden) auf die vollständige Zeichnung eines Anlegers erheben können und die Anwendung einer Antiverwässerungsgebühr möglicherweise nicht berücksichtigen. Zur Klarstellung gilt, dass die Gebühren anders als die Ausgabeaufschläge nach wie vor auf Basis des nicht berichtigten Nettoinventarwerts zur Preisanpassung berechnet werden.

Eine Anpassung des Nettoinventarwerts je Anteil findet nur statt, wenn eine Preisanpassung vorgenommen wird. Im Falle von Nettokapitalzuflüssen wird bei Anwendung der Antiverwässerungsgebühr diese von jedem Zeichnungsbetrag abgezogen, wodurch sich die Anzahl der von einem Anleger erhaltenen Anteile reduziert, im Falle von Nettokapitalabflüssen wird sie von jedem Rückzahlungsbetrag abgezogen, wodurch sich die von einem Anleger erhaltenen Rücknahmeerlöse reduzieren. Der Betrag der Antiverwässerungsgebühr beträgt maximal 2 % und kann im Ermessen des Verwaltungsrats reduziert oder erlassen werden. Im Falle einer Preisanpassung wird die Anpassung 2 % nicht überschreiten. Bei außergewöhnlichen Marktbedingungen, wie z. B. in Phasen hoher Volatilität, verminderter Anlagenliquidität und Marktspannungen, kann sie jedoch deutlich höher sein.

Details zu den einzelnen Mechanismen sind in den aktuellen Angebotsunterlagen der Gesellschaft auf den Seiten 46 bis 48 aufgeführt.

# Erläuterungen zum Abschluss

## für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

### 14. Antiverwässerungsmechanismen (Fortsetzung)

#### Preisanpassung

Die Gesellschaft hat während des Geschäftsjahres eine partielle Swing-Pricing-Anpassung vorgenommen.

Während des Jahres wurde für den in Frage kommenden Teilfonds Corporate Euro Bond Fixed Term 2027 keine vollständige Swing-Pricing-Anpassung vorgenommen.

Informationen darüber, welcher Antiverwässerungsmechanismus bei einem bestimmten Teilfonds anwendbar ist, sind bei der Verwaltungsgesellschaft erhältlich. Sollte die Gesellschaft beschließen, den aktiven Antiverwässerungsmechanismus für einen bestimmten Teilfonds zu ändern (d. h. von einer Preisanpassung zu einer Antiverwässerungsgebühr oder umgekehrt), muss eine vorherige Genehmigung von den maßgeblichen Aufsichtsbehörden eingeholt werden (sofern erforderlich) und die betroffenen Anleger werden mindestens einen Monat im Voraus darüber benachrichtigt.

In der nachstehenden Tabelle ist der Nettoinventarwert je Anteil in der Referenzwährung jedes Fonds vor der Preisanpassung (der „NIW ohne Swing-Korrektur je Anteil“) und der Nettoinventarwert je Anteil in der Referenzwährung jedes Fonds nach der Preisanpassung (der „NIW mit Swing-Korrektur je Anteil“) für Teilfonds angegeben, die am 30. Juni 2023 einer Preisanpassung unterlagen.

Eine Liste der Teilfonds, die während des Geschäftsjahres den Preisanpassungsmechanismus angewendet haben (unabhängig von einer Anpassung des Nettoinventarwerts), finden Sie unter

<https://www.assetmanagement.hsbc.co.uk/en/intermediary/fund-centre>.

In der nachstehenden Tabelle ist der Nettoinventarwert je Anteil in der Referenzwährung jedes Fonds vor der Preisanpassung (der „NIW ohne Swing-Korrektur je Anteil“) und der Nettoinventarwert je Anteil in der Referenzwährung jedes Fonds nach der Preisanpassung (der „NIW mit Swing-Korrektur je Anteil“) für Teilfonds angegeben, die am 31. März 2024 einer Preisanpassung unterlagen.

| Teilfonds   |           | NIW je Anteil ohne Swing-Korrektur* | NIW je Anteil mit Swing-Korrektur |
|---|-----------|-------------------------------------|-----------------------------------|
| <b>Asia Pacific ex Japan Equity High Dividend</b> | AC        | 30,53                               | 30,46                             |
|   | AS        | 20,65                               | 20,59                             |
|   | AM2       | 9,16                                | 9,13                              |
|   | EC        | 28,14                               | 28,07                             |
|   | IC        | 30,56                               | 30,48                             |
|   | XC        | 11,72                               | 11,70                             |
|   | XD        | 11,46                               | 11,44                             |
|   | ZS        | 21,62                               | 21,56                             |
|   | S 95      | 12,82                               | 12,79                             |
|   | IC EUR    | 24,06                               | 24,00                             |
|   | XD EUR    | 11,14                               | 11,11                             |
|   | BC EUR    | 12,03                               | 12,00                             |
|   | BD EUR    | 12,05                               | 12,02                             |
|   | BS GBP    | 20,63                               | 20,58                             |
|   | AM3O RMB  | 1,17                                | 1,17                              |
|   | AM2 HKD   | 1,18                                | 1,18                              |
|   | S48M2 SGD | 7,87                                | 7,85                              |
| <b>Indian Equity</b>                              | AC        | 297,94                              | 299,17                            |
|   | AD        | 293,83                              | 295,04                            |
|   | J1C       | 12,99                               | 13,04                             |
|   | EC        | 268,30                              | 269,40                            |
|   | ED        | 266,38                              | 267,47                            |
|   | IC        | 356,39                              | 357,85                            |
|   | ID        | 334,99                              | 336,36                            |
|   | FC        | 360,69                              | 362,17                            |
|   | XD        | 17,54                               | 17,61                             |
|   | ZC        | 17,93                               | 18,01                             |
|   | ZD        | 339,67                              | 341,06                            |
|   | BC        | 26,33                               | 26,44                             |
|   | BD        | 25,80                               | 25,90                             |
|   | AC EUR    | 28,54                               | 28,66                             |
| AD EUR  | 24,88     | 24,98                               |                                   |

# Erläuterungen zum Abschluss

für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## 14. Antiverwässerungsmechanismen (Fortsetzung)

| Teilfonds                      |          | NIW je Anteil ohne Swing-Korrektur* | NIW je Anteil mit Swing-Korrektur |
|--------------------------------|----------|-------------------------------------|-----------------------------------|
|                                | IC EUR   | 23,02                               | 23,11                             |
|                                | AC GBP   | 33,26                               | 33,39                             |
|                                | AD GBP   | 32,81                               | 32,95                             |
|                                | BC GBP   | 35,53                               | 35,68                             |
|                                | BD GBP   | 34,56                               | 34,70                             |
|                                | AC CHF   | 19,78                               | 19,86                             |
|                                | AD HKD   | 2,13                                | 2,13                              |
| <b>GEM Debt Total Return</b>   | N1C      | 10,24                               | 10,22                             |
|                                | L1C      | 15,95                               | 15,91                             |
|                                | L1D      | 10,65                               | 10,62                             |
|                                | M1C      | 14,89                               | 14,85                             |
|                                | M1D      | 10,39                               | 10,37                             |
|                                | FC       | 15,14                               | 15,10                             |
| <b>GEM Debt Total Return</b>   | BC       | 9,85                                | 9,82                              |
|                                | N1CH EUR | 9,14                                | 9,12                              |
|                                | L1C EUR  | 13,70                               | 13,67                             |
|                                | L1CH EUR | 9,87                                | 9,84                              |
|                                | L1DH EUR | 6,82                                | 6,80                              |
|                                | M1C EUR  | 13,60                               | 13,57                             |
|                                | M1D EUR  | 10,37                               | 10,35                             |
|                                | M1CH EUR | 9,35                                | 9,33                              |
|                                | M1DH EUR | 7,85                                | 7,84                              |
|                                | N1DH EUR | 7,81                                | 7,79                              |
|                                | BCH EUR  | 9,53                                | 9,51                              |
|                                | L1CH CHF | 9,32                                | 9,30                              |
| <b>Global Bond</b>             | AC       | 16,24                               | 16,25                             |
|                                | AD       | 11,96                               | 11,96                             |
|                                | AM2      | 10,30                               | 10,30                             |
|                                | EC       | 12,06                               | 12,07                             |
|                                | IC       | 17,61                               | 17,62                             |
|                                | PD       | 9,75                                | 9,76                              |
|                                | ZD       | 12,31                               | 12,31                             |
|                                | WC GBP   | 16,65                               | 16,66                             |
|                                | AM2 HKD  | 1,05                                | 1,05                              |
| <b>Global High Income Bond</b> | AC       | 15,85                               | 15,82                             |
|                                | AD       | 11,70                               | 11,68                             |
|                                | AM2      | 8,06                                | 8,04                              |
|                                | EC       | 12,17                               | 12,14                             |
|                                | IC       | 14,00                               | 13,96                             |
|                                | ID       | 9,39                                | 9,37                              |
|                                | IM2      | 8,33                                | 8,31                              |
|                                | ACH EUR  | 11,28                               | 11,25                             |
|                                | ADH EUR  | 8,36                                | 8,34                              |
|                                | ECH EUR  | 10,98                               | 10,95                             |
|                                | ICH EUR  | 12,49                               | 12,46                             |
|                                | AM3H EUR | 7,82                                | 7,81                              |
|                                | XDH EUR  | 8,98                                | 8,96                              |
|                                | ACH GBP  | 12,90                               | 12,86                             |
|                                | ACH SGD  | 10,54                               | 10,52                             |
|                                | AM3H SGD | 6,06                                | 6,05                              |
|                                | AM3H RMB | 1,06                                | 1,06                              |
|                                | AM3H AUD | 4,75                                | 4,74                              |
|                                | ACH CAD  | 7,87                                | 7,85                              |

\* Preise je Anteil sind in der Währung des betreffenden Teilfonds ausgewiesen.

# Erläuterungen zum Abschluss

für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## 14. Antiverwässerungsmechanismen (Fortsetzung)

| Teilfonds                                     |          | NIW je Anteil ohne Swing-Korrektur* | NIW je Anteil mit Swing-Korrektur |
|---|----------|-------------------------------------|-----------------------------------|
| Global Lower Carbon Bond                      | AC       | 10,91                               | 10,92                             |
|   | AD       | 10,24                               | 10,26                             |
|   | AM2      | 8,95                                | 8,96                              |
|   | IC       | 9,97                                | 9,98                              |
|   | XC       | 11,31                               | 11,32                             |
|   | ZQ1      | 10,17                               | 10,19                             |
|   | BC       | 9,31                                | 9,32                              |
|   | ACH EUR  | 10,44                               | 10,46                             |
|   | ADH EUR  | 9,09                                | 9,10                              |
|   | ZQ1H EUR | 9,09                                | 9,10                              |
|   | ACH GBP  | 11,73                               | 11,74                             |
|   | ZQ1H GBP | 11,47                               | 11,48                             |
|   | BCH GBP  | 12,14                               | 12,16                             |
|   | ZQ1H CHF | 9,02                                | 9,03                              |
|   | AM3H SGD | 6,06                                | 6,07                              |
|   | AM2 HKD  | 1,14                                | 1,14                              |
| AM3H AUD                                      | 5,31     | 5,32                                |                                   |
| Managed Solutions – Asia Focused Conservative | AC       | 12,55                               | 12,53                             |
|   | AM2      | 8,76                                | 8,75                              |
|   | ACO EUR  | 11,24                               | 11,22                             |
|   | ACO SGD  | 8,84                                | 8,82                              |
|   | AM3O RMB | 1,17                                | 1,17                              |
|   | AC HKD   | 1,62                                | 1,62                              |
|   | AM2 HKD  | 1,13                                | 1,13                              |
| ACO AUD                                       | 8,26     | 8,25                                |                                   |

\* Preise je Anteil sind in der Währung des betreffenden Teilfonds ausgewiesen.

# Erläuterungen zum Abschluss

## für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

### 15. Gesamtkostenquote

Die Gesamtkostenquote („TER“) wurde von der Verwaltungsstelle gemäß den Anforderungen der Richtlinien der AMAS (Asset Management Association Switzerland) bezüglich der Berechnung und der Offenlegung der Gesamtkostenquote von Organismen für gemeinsame Anlagen berechnet. Die tatsächlich während des Zeitraums angefallenen Aufwendungen werden annualisiert und als Prozentsatz des durchschnittlichen verwalteten Vermögens der Anteilsklasse für den Zeitraum berechnet. Die Gesamtkostenquote enthält auch die Prozentsätze für passive Absicherungsgebühren.

Die synthetische Gesamtkostenquote gilt für jeden Teilfonds, der mindestens 10 % seines Nettovermögens als Dachfonds in andere Organismen für gemeinsame Anlagen (Zielfonds) investiert, die eine Gesamtkostenquote im Sinne der vorliegenden Leitlinien veröffentlichen. Eine zusammengesetzte (synthetische) Gesamtkostenquote des Dachfonds wird von der Verwaltungsstelle zum Stichtag des Berichtszeitraums oder zum Ende des Berichtszeitraums berechnet.

### 16. Liquidation von Teilfonds

Die folgenden Teilfonds wurden im Laufe des Berichtszeitraums oder während vorheriger Berichtszeiträume geschlossen. Zum 31. März 2024 werden die folgenden Barmittelbestände noch von der „Depotbank“ der folgenden liquidierten Teilfonds gehalten:

|                   | China Consumer Opportunities<br>(geschlossen zum 25. Mai 2021)<br>USD                            | China Multi-Asset Income<br>(geschlossen zum 26. Oktober 2020)<br>USD                         | Economic Scale GEM Equity<br>(geschlossen zum 22. Oktober 2020)<br>USD                             | Economic Scale Global Equity<br>(geschlossen zum 15. April 2021)<br>USD                  |
|-------------------|--|---|--|--|
| Bankguthaben      | 6.319  | 31  | 362.586  | 47.901   |
| Banküberziehungen | -  | -   | -  | -  |
|                   | Economic Scale Japan Equity<br>(geschlossen zum 8. Dezember 2021)<br>JPY                         | Emerging Wealth<br>(geschlossen zum 10. Mai 2021)<br>USD                                      | Euro Convertible Bond<br>(geschlossen zum 23.03.2023)<br>EUR                                       | Global Corporate Fixed Term Bond 2022<br>(geschlossen zum 06.01.2022)<br>USD             |
| Bankguthaben      | 2.536.536  | 14.137  | 108  | 210.909  |
| Banküberziehungen | -  | -   | -  | -  |
|                   | Global Credit Floating Rate Fixed Term Bond 2022 - 1<br>(geschlossen zum 10. Januar 2023)<br>USD | Global Credit Floating Rate Fixed Term Bond 2023 - 1<br>(geschlossen zum 5. Juli 2023)<br>USD | Global Credit Floating Rate Fixed Term Bond 2023 - 2<br>(geschlossen zum 29. Dezember 2023)<br>USD | Global Emerging Markets Inflation Linked Bond<br>(geschlossen zum 9. Januar 2020)<br>USD |
| Bankguthaben      | 1.334  | 289.036   | 177.782  | 193  |
| Banküberziehungen | -  | -   | -  | -  |
|                   | GEM Equity Volatility Focused<br>(geschlossen zum 2. Dezember 2020)<br>USD                       | Mexico Equity<br>(geschlossen zum 28. Juli 2023)<br>USD                                       | UK Equity<br>(geschlossen zum 3. Juli 2020)<br>GBP   |  |
| Bankguthaben      | 48.888   | 144   | 19.764   |  |
| Banküberziehungen | -  | -   | -  |  |

Zum 31. März 2024 werden die folgenden Wertpapiere noch von der „Depotbank“ der folgenden liquidierten Teilfonds gehalten:

| Teilfonds   | Beschreibung               | Anzahl  |
|---|----------------------------|---------|
| Economic Scale GEM Equity*                              | Folli Follie Group         | 3.361   |
| Economic Scale GEM Equity*                              | Yes Bank                   | 125.960 |
| Economic Scale GEM Equity*                              | INTER RAO UES              | 1       |
| Economic Scale GEM Equity*                              | Wintek Corp                | 333.820 |
| Global Credit Floating Rate Fixed Term Bond 2023 - 1**  | HSBC Global Liquidity Fund | 3       |
| Global Credit Floating Rate Fixed Term Bond 2023 - 2*** | HSBC Global Liquidity Fund | -       |
| ASEAN Equity****  | Security BK VAR            | 54.010  |

\*Geschlossen zum 22. Oktober 2020. Dieser Vermögenswert wurde nicht veräußert, da die Transaktion aufgrund der Beschränkungen auf dem Markt nicht zulässig war.

\*\* Geschlossen zum 5. Juli 2023. Für diesen Vermögenswert wurde die vollständige Rücknahme beantragt, die damit verbundenen Zinsen wurden jedoch vom Kontrahenten zum 31. März 2024 noch nicht getilgt, sondern erst im Mai 2024.

\*\*\* Geschlossen zum 29. Dezember 2023. Für diesen Vermögenswert wurde die vollständige Rücknahme beantragt, die damit verbundenen Zinsen wurden jedoch vom Kontrahenten zum 31. März 2024 noch nicht getilgt, sondern erst im Mai 2024. Die verbleibende Anzahl beläuft sich auf 0,54 Anteile.

\*\*\*\* Geschlossen zum 25. März 2019. Dieser Vermögenswert wurde nicht veräußert, da die Transaktion aufgrund der Beschränkungen auf dem Markt nicht zulässig war. Der Teilfonds, auf den verwiesen wird, unterscheidet sich von dem bestehenden Teilfonds „ASEAN Equity“, der in der Nettovermögensaufstellung aufgeführt ist.

# Erläuterungen zum Abschluss

## für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

### 17. Bedeutende Ereignisse

#### Russlands Einmarsch in die Ukraine

Der Einmarsch Russlands in die Ukraine hatte schwerwiegende Auswirkungen auf die regionalen und globalen Wirtschaftsmärkte für Wertpapiere und Rohstoffe und könnten dies auch weiterhin haben. Als Reaktion auf das Vorgehen Russlands haben verschiedene Regierungen weitreichende Wirtschaftssanktionen gegen Russland erlassen, darunter:

- ein Verbot der Geschäftstätigkeit mit bestimmten russischen Unternehmen, großen Finanzinstituten, Beamten und Oligarchen;
- den Ausschluss ausgewählter russischer Banken aus der Society for Worldwide Interbank Financial Telecommunications („SWIFT“), dem elektronischen Banknetzwerk, das Banken weltweit verbindet, durch bestimmte Länder und die Europäische Union; und
- restriktive Maßnahmen, um zu verhindern, dass die russische Zentralbank die Auswirkungen der Sanktionen untergräbt.

Die aktuellen Ereignisse, einschließlich Sanktionen und potenzieller künftiger Sanktionen, insbesondere solcher, die den Energiesektor Russlands beeinflussen, und andere Maßnahmen sowie Russlands Vergeltungsmaßnahmen auf diese Sanktionen und Maßnahmen, könnten weiterhin negative Auswirkungen auf die Performance und Liquidität der globalen Märkte haben und damit den Wert der Anlagen der Teilfonds über ein direktes Engagement in russischen Emittenten hinaus negativ beeinflussen. Diese Ereignisse bergen außerdem erhebliche Unsicherheiten und Risiken in Bezug auf die globalen Märkte, und die Wertentwicklung der Teilfonds und ihre Anlagen oder Geschäftstätigkeit könnte beeinträchtigt werden. Anleger sollten sich darüber im Klaren sein, dass die Dauer der anhaltenden Kriegshandlungen und die Vielzahl von Sanktionen und die damit verbundenen Ereignisse nicht vorhersehbar sind.

#### Auswirkungen der Ukraine-Russland-Krise

Der Verwaltungsrat hat beschlossen, den Teilfonds HGIF Russia Equity am 1. März 2022 bis auf Weiteres auszusetzen. Die Situation wird weiterhin gemeinsam vom Verwaltungsrat und der Verwaltungsgesellschaft überwacht. Jede spätere Entscheidung, die zu einer Änderung dieses Status führt, wird den Anlegern zu gegebener Zeit mitgeteilt.

Ab dem 2. März 2022 wurden alle auf RUB lautenden russischen Staatsanleihen und alle damit verbundenen Kupons, die im HGIF Global Emerging Markets Local Debt, im HGIF Global Emerging Markets ESG Local Debt und im HGIF Global Emerging Market Multi-Asset Income gehalten werden, auf 0 abgeschrieben.

Ab dem 3. März 2022 wurden alle russischen Aktien des HGIF Global Emerging Markets Multi-Asset Income, des HGIF Global Equity Volatility Focused, des HGIF BRIC Markets Equity und des HGIF BRIC Equity um 90 % reduziert. Wenn bei ADR/GDR der Marktpreis um mehr als 90 % gefallen ist, wurde der Titel mit dem letzten Marktpreis bewertet. Ab dem 10. März 2022 wurden alle auf RUB lautenden russischen Aktien, die im HGIF Global Emerging Markets Multi-Asset Income, im HGIF Global Equity Volatility Focused, im HGIF BRIC Markets Equity und im HGIF BRIC Equity gehalten werden, auf 0 abgeschrieben.

Das auf USD lautende und an der US-Börse notierte Wertpapier Yandex liegt seit dem 11. März 2022 bei 0. Dieses Wertpapier wird von HGIF BRIC Markets Equity und HGIF BRIC Equity gehalten. Die Wertpapiere von Sberbank PJSC ADR, Rosneft IIGDR und Severstal PJSC GDR wurden ab dem 2. Juni 2022 mit 0 bewertet. Diese Wertpapiere werden vom HSBC GIF Russia Equity und vom HSBC GIF BRIC Markets Equity gehalten.

Die Wertpapiere von Gazprom PJSC ADR, Lukoil PJSC und Novatek PJSC GDR wurden ab dem 1. Juli 2022 mit 0 bewertet. Diese Wertpapiere werden vom HSBC GIF Russia Equity gehalten.

Aufgrund weiterer Sanktionen wurde Magnit PJSC GDR seit dem 7. Dezember 2022 ebenfalls auf 0 abgeschrieben. Dieses Wertpapier wird vom HGIF Global Equity Volatility Focused gehalten.

Schließlich wurden aufgrund weiterer Sanktionen die folgenden im HGIF Russia Equity gehaltenen Wertpapiere auf 0 abgeschrieben: MMC Norilsk Nickel PJSC ADR(V0.1 Ord), Novolipetsk Steel PJSC GDR(V10 Ord) Reg S, TCS Group Holding PLC USD0.01 GDR(V1 Ord), Tatneft Sponsored ADR(V6 Ord) und X5 Retail Group NV GDR V.25.

#### Änderungen im Verwaltungsrat

Herr John Li trat mit Wirkung vom 30. September 2023 als Verwaltungsratsmitglied zurück und Herr Timothy Palmer wurde (durch Kooptation des Verwaltungsrats) mit Wirkung vom 2. Oktober 2023 ernannt.

Herr Jean de Courrèges trat am 31. März 2024 aus dem Verwaltungsrat zurück.



# Erläuterungen zum Abschluss

für das Geschäftsjahr zum 31. März 2024 (Fortsetzung)

## 18. Ereignisse nach dem Bilanzstichtag

Frau Carine Feipel wurde durch Kooptation des Verwaltungsrats am 2. April 2024 zum unabhängigen Verwaltungsratsmitglied ernannt.

Der Brazil Bond wurde zum 15. Mai 2024 geschlossen.

# Anhang I (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Besteuerung der Gesellschaft (ausländische Staaten)

Folgende Zusammenfassung basiert auf dem Verständnis der Gesellschaft der in den anderen Gerichtsbarkeiten anwendbaren Gesetze und gängigen Praxis und unterliegt Änderungen daran.

## *Belgien*

Die belgische Regierung hat ein Gesetz verabschiedet, das eine jährliche Steuer auf den Nettoinventarwert von bei der Finanzmarktaufsichtsbehörde FSMA registrierten ausländischen Investmentfonds einführt. Für in Belgien durch belgische Finanzintermediäre platzierte Teilfonds wird eine jährliche Steuer in Höhe von 0,0925 % auf den Nettoinventarwert der betreffenden zum 31. Dezember des Vorjahres umlaufenden Anteile erhoben.

Da die Beträge bis jetzt gering sind, hat die Verwaltungsgesellschaft diese Steuer im Namen der Gesellschaft aus den Betriebskosten, Verwaltungs- und Kontoführungsgebühren bezahlt, die ihr entrichtet werden. Sollte dieser Betrag jedoch erheblich ansteigen oder langfristig belastet werden, könnte die Verwaltungsgesellschaft fordern, dass die betreffenden Teilfonds diese Steuer in zukünftigen Berichtszeiträumen selbst übernehmen.

## *China*

Investiert die Gesellschaft in Aktien und Wertpapiere, die von Unternehmen mit Steuersitz (oder Hauptaktivität) in der Volksrepublik China („VRC“) emittiert werden, in Wertpapiere von staatlichen Behörden in der VRC oder in andere zulässige Anlagen der VRC, dann kann die Gesellschaft Körperschafts-, Quellen- und anderen in der VRC anfallenden Steuern unterliegen. Gemäß Rundschreiben Caishui [2014] Nr. 79 sind Kapitalgewinne, die nach dem 17. November 2014 von einem QFII/RQFII aus der Übertragung von Aktienanlagen erzielt werden, vorübergehend von der Körperschaftssteuer der VRC („CIT“) befreit. Gemäß Guoshuifa [2009] 47 unterliegen von einem QFII vereinnahmte Dividenden, Kupons oder Zinsen einer CIT von 10 %. Zu diesem Zeitpunkt galt für RQFII die gleiche Praxis. Am 30. August 2018 gaben MOF und SAT gemeinsam Caishui [2018] 108 heraus, das eine vorübergehende dreijährige Befreiung von der CIT für Kuponeinnahmen ausländischer institutioneller Anleger am chinesischen Anleihemarkt vom 7. November 2018 bis zum 6. November 2021 vorsieht. Gemäß Rundschreiben Caishui [2014] Nr. 81 und Caishui [2016] Nr. 127 sind von Hongkong-Anlegern über Shanghai-Hong Kong Stock Connect und Shenzhen-Hong Kong Stock Connect aus dem Handel mit A-Aktien realisierte Kapitalgewinne vorübergehend von der CIT befreit. Von Hongkong-Anlegern erhaltene Dividendenerträge unterliegen zurzeit einer CIT von 10 %, die vom Emittenten einbehalten wird. Gegebenenfalls kann jedoch die Steuerbefreiung im Rahmen des Abkommens zur Anwendung kommen. Bei Verkauf oder Übertragung chinesischer A-Aktien durch Nachfolge und Schenkung müssen der Verkäufer der A-Aktien bzw. der Übertragende eine Stempelsteuer in Höhe von 0,1 % der Gegenleistung/des Werts zahlen. Die Stempelsteuer wird von der Börse vom Abrechnungsbetrag abgezogen. Anleger am Markt in Hongkong sind vorübergehend von der Stempelsteuer auf Aktienleihen und Renditen aus gedeckten Aktienleerverkäufen durch Shanghai-Hong Kong Stock Connect und Shenzhen-Hong Kong Stock Connect befreit.

Am 23. März 2016 gaben das Finanzministerium und SAT gemeinsam die Mitteilung Caishui [2016] Nr. 36 heraus, das genaue Richtlinien zur Umsetzung der Umsatzsteuerreform enthält. Ab dem 1. Mai 2016 hat die Umsatzsteuer die chinesische Gewerbesteuer („VRC-BT“) ersetzt, um alle Sektoren abzudecken, die früher unter die VRC-BT fielen. Gemäß Mitteilung Nr. 36 sind Kapitalgewinne, die von QFII aus Wertpapieren, die über vertrauenswürdige Onshore-Unternehmen in China gehandelt werden, und Kapitalgewinne, die von Hongkong-Anlegern über Shanghai-Hong Kong Stock Connect aus dem Handel mit A-Aktien erzielt werden, von der VRC-Umsatzsteuer befreit. Das Rundschreiben Caishui [2016] Nr. 127 sieht für Kapitalgewinne, die von Hongkong-Anlegern über Shanghai-Hong Kong Stock Connect aus dem Handel mit A-Aktien erzielt werden, eine Befreiung von der Mehrwertsteuer vor.

Am 30. Juni 2016 gaben das Finanzministerium und die State Administration for Taxation („SAT“) gemeinsam das ergänzende Rundschreiben Caishui [2016] Nr. 70 heraus, das eine Befreiung von der Umsatzsteuer („USt.“) auf Kapitalgewinne vorsieht, die von einem RQFII aus Wertpapieren erzielt werden, die über vertrauenswürdige Onshore-Unternehmen in China gehandelt werden, sowie auf Kapitalgewinne, die von ausländischen Institutionen erzielt werden, die von der People's Bank of China für die Anlage im lokalen Interbanken-Währungsmarkt zugelassen sind.

Am 30. August 2018 gaben MOF und SAT gemeinsam Caishui [2018] 108 heraus, das eine vorübergehende dreijährige Befreiung von der VAT für Kuponeinnahmen ausländischer institutioneller Anleger am chinesischen Anleihemarkt vom 7. November 2018 bis zum 6. November 2021 vorsieht.

# Anhang I (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Besteuerung der Gesellschaft (ausländische Staaten) (Fortsetzung)

## Deutschland

Die nachfolgend aufgeführten Teilfonds sind bestrebt, kontinuierlich einen Mindestprozentsatz ihres Nettovermögens in Kapitalbeteiligungen im Sinne von § 2 Abs. 8 InvStG 2018 zu investieren:

| % des Nettovermögens des Teilfonds | Teilfonds  |
|------------------------------------|--|
| More than 50%                      | All Equity Sub-Funds other than Russia Equity<br>Managed Solutions – Asia Focused Growth |
| At least 25%                       | Russia Equity<br>Managed Solutions - Asia Focused Income                                 |

## Hongkong

Die Gesellschaft kann in Bezug auf einen bestimmten Teilfonds, der steuerlich als in Hongkong gewerbe- oder geschäftstätig behandelt wird, einer Gewinnsteuer entweder auf eigene Kosten oder durch Besteuerung der Vertretung des Anlageberaters dieses Teilfonds unterliegen. Wird die Gesellschaft steuerlich als in Hongkong gewerbe- oder geschäftstätig behandelt, so unterliegt sie einer Gewinnsteuer von derzeit 16,5 %. Die Steuer entfällt ausschließlich auf Gewinne des betreffenden Teilfonds, die aus dessen Gewerbe- oder Geschäftstätigkeit in Hongkong erzielt werden und bei denen es sich nicht um Kapitalgewinne handelt.

Gemäß den Gesetzen und Gepflogenheiten zur Besteuerung in Hongkong sind Fonds, die außerhalb von Hongkong domiziliert sind („Offshore-Fonds“), unter gewissen Umständen von der Gewinnsteuer in Hongkong befreit. Die Gesellschaft beabsichtigt ihre Geschäfte so weit wie möglich dergestalt zu führen, dass sie den Bedingungen für eine Befreiung von der Gewinnsteuer entsprechen. Die Gesellschaft kann jedoch keine Garantie dafür geben, dass diese Steuerbefreiung in jedem Fall erreicht wird.

## Indien

Die Indian General Anti-Avoidance Rules („GAAR“) gelten ab 1. April 2017. Die GAAR räumt den Steuerbehörden einen erheblichen Ermessensspielraum ein und ausländischen Investoren könnten damit etwaige aus Doppelbesteuerungsabkommen erwachsende Vorteile vorenthalten werden. Derartige Maßnahmen könnten erhebliche Kosten für die Anleger verursachen, da Kapitalgewinne, auch wenn sie gemäß einem Steuerabkommen nicht steuerpflichtig sind, in Indien besteuert werden könnten. Bei den GAAR handelt es sich um eine neue Rechtsvorschrift, daher gibt es nicht viele Leitlinien bezüglich ihrer Anwendung.

Seit der am 1. April 2018 in Kraft getretenen Änderung gelten für Foreign Portfolio Investors (FPI) folgende Kapitalertragsteuersätze:

- Börsennotierte Stammaktien (Verkaufstransaktion über eine Börse, für die Finanztransaktionssteuer gezahlt wurde):  
Langfristige Kapitalgewinne (Vermögenswerte wurden vor dem Verkauf länger als 12 Monate gehalten) – 10 %  
Kurzfristige Kapitalgewinne (Vermögenswerte wurden vor dem Verkauf 12 Monate oder weniger gehalten) – 15 %
- Sonstige Vermögenswerte:  
Langfristige Kapitalgewinne (Vermögenswerte wurden vor dem Verkauf länger als 36 Monate gehalten) – 10 %  
Kurzfristige Kapitalgewinne (Vermögenswerte wurden vor dem Verkauf 36 Monate oder weniger gehalten) – 30 %

Die obigen Steuersätze gelten zuzüglich anwendbarer Zuschläge und Ausbildungsabgaben.

Zinserträge aus indischen Wertpapieren unterliegen einer Ertragssteuer von 20 % auf die Bruttoverzinsung (zuzüglich anwendbarer Zuschläge und Ausbildungsabgaben). Auf Zinserträge, die zwischen dem 1. Juli 2017 und dem 30. Juni 2023 von FPI aus bestimmten Wertpapieren (Staatsanleihen und auf Rupie lautende Anleihen eines indischen Unternehmens) erzielt wurden, wird ein ermäßigter Steuersatz von 5 % (zuzüglich anwendbarer Zuschläge und Ausbildungsabgaben) erhoben. Darüber hinaus wurde der ermäßigte Steuersatz von 5 % (zuzüglich anwendbarer Zuschläge und Ausbildungsabgaben) auch auf Zinserträge ausgeweitet, die im Zeitraum vom 1. April 2020 bis zum 30. Juni 2023 aus kommunalen Schuldtiteln erzielt werden.

Mit Wirkung zum 1. April 2020 unterliegen Dividendenerträge, die von FPIs aus einem inländischen indischen Unternehmen erzielt werden, einem Steuersatz von 20 % (zuzüglich anwendbarer Zuschläge und Ausbildungsabgaben)

Die obigen Steuersätze basieren auf inländischem Steuerrecht und sind ggf. vorbehaltlich eines vergünstigten Zinssatzes, den ein Doppelbesteuerungsabkommen bietet.

# Anhang I (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Besteuerung der Gesellschaft (ausländische Staaten) (Fortsetzung)

## Vereinigtes Königreich

Der Verwaltungsrat hat die Absicht, die Geschäfte der Gesellschaft so zu führen, dass sie keine Gesellschaft mit Sitz im Vereinigten Königreich wird. Wenn die Gesellschaft steuerrechtlich ihren Sitz nicht im Vereinigten Königreich hat, sollten ihre Erträge und Kapitalgewinne nicht der britischen Körperschaftsteuer unterliegen.

## Frankreich

Gilt derzeit für Euroland Value, Euroland Equity Smaller Companies und Euroland Growth.

### „Plan d'Epargne en Actions“.

Damit ein Teilfonds für sich in Anspruch nehmen kann, die Anforderungen für einen französischen „Plan d'Epargne en Actions“ zu erfüllen, und solange die Teilfonds bei der *Autorité des Marchés Financiers* in Frankreich registriert sind, gilt die folgende zusätzliche Anlagebeschränkung:

Der Gesamtanteil der Anlagen in Aktien und aktienähnlichen Wertpapieren (gemäß Definition in Art. L-221-31 des französischen Code Monétaire et Financier, § I-1°, a, b und c) von Unternehmen, die ihren Sitz in einem Mitgliedstaat:

- der EU oder
- des Europäischen Wirtschaftsraums haben (vorausgesetzt, dass das jeweilige Land ein bilaterales Besteuerungsabkommen mit Frankreich mit einer Bestimmung zur administrativen Unterstützung bei der Bekämpfung von Steuerbetrug und Steuerhinterziehung geschlossen hat),

darf zu keinem Zeitpunkt weniger als 75 % des Gesamtvermögens des jeweiligen Teilfonds betragen.

Per Definition gemäß Art. L- 221-31, § I-1°, a, b und c des französischen Code Monétaire et Financier sind Aktien und aktienähnliche Wertpapiere, die von Unternehmen emittiert werden, die in ihrem Heimatland nicht der Unternehmenssteuer zum normalen Satz unterliegen, ausgeschlossen. Ausdrücklich ausgeschlossen sind auch Anteile von börsennotierten Immobiliengesellschaften („SIIC“, „sociétés d'investissements immobiliers cotées“).

Die folgenden Teilfonds sind ab dem 1. April 2007 zugelassen:

|                                   | % der Beteiligungen in Anteilen |
|-----------------------------------|---------------------------------|
| Euroland Equity Smaller Companies | 96.42                           |
| Euroland Growth                   | 97.27                           |
| Euroland Value                    | 95.64                           |

### Artikel 150-0D des Code Général des Impôts.

Damit ein Teilfonds die Zulassungskriterien von Artikel 150-0D, Absatz 1 ter des französischen Finanzgesetzes (Code Général des Impôts) erfüllt, darf der Gesamtbetrag, der in Aktien oder aktienähnlichen Wertpapieren angelegt wird, zu keinem Zeitpunkt weniger als 75 % des Gesamtvermögens des jeweiligen Teilfonds betragen.

Die folgenden Teilfonds sind ab dem 1. April 2007 zugelassen:

|                                   | % der Beteiligungen in Anteilen |
|-----------------------------------|---------------------------------|
| Euroland Equity Smaller Companies | 96.87                           |
| Euroland Value                    | 98.06                           |
| Europe Value                      | 98.50                           |

# Anhang II (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – UK SORP Offenlegung (Fortsetzung)

## Anlagerisiko

Nachstehend finden Sie Informationen in Bezug auf bestimmte Anlagerisiken für ausgewählte Teilfonds:

### Marktrisiko

Das Marktrisiko ist das Risiko, dass der beizulegende Zeitwert oder die künftigen Zahlungsströme von Finanzinstrumenten aufgrund von Veränderungen von Marktvariablen wie Marktpreisen, Wechselkursen und Zinssätzen schwanken. Hierzu gehören drei größere Arten von Risiken: Währungsrisiko, Zinsrisiko und sonstiges Preisrisiko.

Da der Fonds in Aktien und festverzinsliche Wertpapiere investiert, ist er dem Risiko eines Rückgangs an den Aktien- und Rentenmärkten ausgesetzt. Das absolute Risiko wird über das Aktienengagement überwacht, das Risiko im Vergleich zur Benchmark durch die Berechnung des ex-ante Tracking Errors.

### (i) Währungsrisiko

Als Währungsrisiko wird das Risiko einer Schwankung des Zeitwerts oder der künftigen Cashflows eines finanziellen Vermögenswerts aufgrund von Wechselkursveränderungen bezeichnet.

Die Tabelle unten enthält eine Übersicht der Währungsrisiken der folgenden Teilfonds.

| Teilfonds                            | Währung | Nettowährungsengagement in Teilfondswährung |
|--------------------------------------|---------|---|
| China A-Shares Equity                | CNY     | 23.597.253                                  |
| Global Emerging Markets Equity       | HKD     | 82.015.575                                  |
|                                      | INR     | 54.720.517                                  |
|                                      | KRW     | 53.350.061                                  |
|                                      | MXN     | 18.414.085                                  |
|                                      | TWD     | 69.976.734                                  |
|                                      | Andere  | 78.522.844                                  |
| Global Equity Climate Change         | EUR     | 72.152.067                                  |
|                                      | GBP     | 25.266.316                                  |
|                                      | Andere  | 35.417.332                                  |
| Global Equity Sustainable Healthcare | DKK     | 18.979.256                                  |
|                                      | EUR     | 21.405.372                                  |
|                                      | Andere  | 26.004.423                                  |
| Global Infrastructure Equity         | CAD     | 102.336.312                                 |
|                                      | EUR     | 177.118.787                                 |
|                                      | GBP     | 50.301.729                                  |
|                                      | HKD     | 66.885.489                                  |
|                                      | Andere  | 41.113.991                                  |
| Global Real Estate Equity            | EUR     | 56.561.007                                  |
|                                      | GBP     | 50.525.214                                  |
|                                      | JPY     | 50.828.245                                  |
|                                      | Andere  | 60.666.955                                  |
| Global Lower Carbon Equity           | EUR     | 35.501.481                                  |
|                                      | JPY     | 22.506.801                                  |
|                                      | Andere  | 55.137.347                                  |
| Global Sustainable Equity Income     | EUR     | 24.217.050                                  |
|                                      | JPY     | 13.553.986                                  |
|                                      | Andere  | 36.680.500                                  |
| Global Sustainable Long Term Equity  | CHF     | 6.671.954                                   |
|                                      | DKK     | 9.063.846                                   |
|                                      | EUR     | 16.315.239                                  |
|                                      | Andere  | 6.245.049                                   |
| Frontier Markets                     | AED     | 95.032.330                                  |
|                                      | EUR     | 24.098.712                                  |
|                                      | PHP     | 36.201.708                                  |
|                                      | QAR     | 24.527.540                                  |
|                                      | RON     | 29.921.651                                  |
|                                      | SAR     | 39.181.927                                  |
|                                      | VND     | 68.735.703                                  |
|                                      | Andere  | 53.051.739                                  |

# Anhang II (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – UK SORP Offenlegung (Fortsetzung)

## Anlagerisiko (Fortsetzung)

### Marktrisiko (Fortsetzung)

#### (i) Währungsrisiko (Fortsetzung)

| Teilfonds                                       | Währung     | Nettowährungsengagement in<br>Teilfondswährung |
|---|-------------|--|
| Global High Yield ESG Bond                      | GBP         | 10.085.528                                     |
|   | Andere      | 582.055  |
| Global High Yield Securitised Credit Bond       | EUR         | 5.432.617                                      |
|   | Andere      | 3.990.686                                      |
| Global Investment Grade Securitised Credit Bond | GBP         | 519.451.617                                    |
|   | Andere      | 133.474.733                                    |
| Global Securitised Credit Bond                  | EUR         | (5.823.846)                                    |
|   | JPY         | 21.069.027                                     |
|   | Andere      | 2.580.788                                      |
| US Short Duration High Yield Bond*              | EUR         | 24.776.156                                     |
|   | Andere      | 596.588  |
| Ultra Short Duration Bond                       | GBP         | 90.230.194                                     |
|   | Andere      | 72.381.604                                     |
| US High Yield Bond                              | CNH         | 3.429.780                                      |
|   | Andere      | 151.223  |
| Global Emerging Markets Multi-Asset Income      | GBP         | 2.953.971                                      |
|   | Andere      | 31.609.610                                     |
| Managed Solutions – Asia Focused Income         | AUD         | 41.882.439                                     |
|   | HKD         | 26.477.931                                     |
|   | KRW         | 25.116.976                                     |
|   | SGD         | 16.209.240                                     |
|   | TWD         | 16.432.471                                     |
|   | Andere      | 47.597.422                                     |
| Multi-Asset Style Factors                       | AUD         | (67.335.511)                                   |
|   | CHF         | (130.977.836)                                  |
|   | COP         | 65.758.423                                     |
|   | GBP         | 236.769.944                                    |
|   | HUF         | 85.808.972                                     |
|   | IDR         | (63.993.441)                                   |
|   | KRW         | (69.100.351)                                   |
|   | NOK         | 136.884.746                                    |
|   | SGD         | (92.296.691)                                   |
|   | USD         | 108.920.193                                    |
| Andere  | 112.564.834 |  |

\* Bis zum 2. Juli 2023 lautete der Name des Teilfonds „Global Short Duration High Yield Bond“.

# Anhang II (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – UK SORP Offenlegung (Fortsetzung)

## Anlagerisiko (Fortsetzung)

### Marktrisiko (Fortsetzung)

#### (ii) Zinsrisiko

Das Zinsrisiko stellt das Risiko dar, dass der beizulegende Zeitwert oder zukünftige Cashflow eines finanziellen Vermögenswerts aufgrund von Marktzinsänderungen schwankt.

Die folgende Tabelle enthält die eingegangenen Zinsrisiken der folgenden Teilfonds:

|   | China A-shares<br>Equity USD | Global Emerging<br>Markets Equity<br>USD | Global Equity<br>Climate Change<br>USD | Global Equity<br>Sustainable<br>Healthcare<br>USD |
|---|------------------------------|--|--|---|
| Bankguthaben  | 10.700                       | 7.308.703                                | 2.770.818                              | 4.123.868   |
| Banküberziehungen                                       | (63.027)                     | (407)                                    | (42)                                   | (44.273)  |
| Anleihen  | -                            | -  | -                                      | -   |
| Zinsswaps   | -                            | -  | -                                      | -   |
| Einlagenzertifikate, Schatzwechsel,<br>Commercial Paper | -                            | -  | -                                      | -   |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere                        | -                            | -  | -                                      | -   |
| <b>Summe</b>  | <b>(52.327)</b>              | <b>7.308.296</b>                         | <b>2.770.776</b>                       | <b>4.079.595</b>                                  |

|   | Global<br>Infrastructure<br>Equity<br>USD | Global Real Estate<br>Equity USD | Global Lower<br>Carbon Equity<br>USD | Global Sustainable<br>Equity Income<br>USD |
|---|---|----------------------------------|--------------------------------------|--|
| Bankguthaben  | 569.088                                   | 9.142.979                        | 5.728.960                            | 1.957.937                                  |
| Banküberziehungen                                       | (3.375.650)                               | -                                | (195.088)                            | -  |
| Anleihen  | -   | -                                | -                                    | -  |
| Zinsswaps   | -   | -                                | -                                    | -  |
| Einlagenzertifikate, Schatzwechsel,<br>Commercial Paper | -   | -                                | -                                    | -  |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere                        | -   | -                                | -                                    | -  |
| <b>Summe</b>  | <b>(2.806.562)</b>                        | <b>9.142.979</b>                 | <b>5.533.872</b>                     | <b>1.957.937</b>                           |

|   | Global Sustainable<br>Long Term Equity<br>USD | Frontier Markets<br>USD | Asia ESG Bond<br>USD | Asia High Yield<br>Bond<br>USD |
|---|---|-------------------------|----------------------|--------------------------------|
| Bankguthaben  | 1.708.751                                     | 4.808.525               | 356.222              | 15.368.018                     |
| Banküberziehungen                                       | (2.012)                                       | (413.692)               | -                    | (845.869)                      |
| Anleihen  | -   | -                       | 25.754.589           | 645.540.901                    |
| Zinsswaps   | -   | -                       | -                    | -                              |
| Einlagenzertifikate, Schatzwechsel,<br>Commercial Paper | -   | -                       | -                    | -                              |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere                        | -   | -                       | -                    | -                              |
| <b>Summe</b>  | <b>1.706.739</b>                              | <b>4.394.833</b>        | <b>26.110.811</b>    | <b>660.063.050</b>             |

|   | ESG Short<br>Duration Credit<br>Bond<br>USD | GEM Debt Total<br>Return USD | Global Bond Total<br>Return USD | Global Emerging<br>Markets Bond<br>USD |
|---|---|------------------------------|---------------------------------|--|
| Bankguthaben  | 30.007                                      | 8.616.243                    | 11.734.362                      | 19.804.757                             |
| Banküberziehungen                                       | (1.294)                                     | (5.320.481)                  | (4.842.171)                     | (9.447.696)                            |
| Anleihen  | 7.311.812                                   | 33.651.986                   | 166.567.904                     | 970.646.622                            |
| Zinsswaps   | -   | (9.197)                      | -                               | -                                      |
| Einlagenzertifikate, Schatzwechsel,<br>Commercial Paper | -   | -                            | -                               | -                                      |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere                        | -   | -                            | 38.941.164                      | -                                      |
| <b>Summe</b>  | <b>7.340.525</b>                            | <b>36.938.551</b>            | <b>212.401.259</b>              | <b>981.003.683</b>                     |

# Anhang II (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – UK SORP Offenlegung (Fortsetzung)

## Anlagerisiko (Fortsetzung)

### Marktrisiko (Fortsetzung)

#### (ii) Zinsrisiko (Fortsetzung)

|  | Global Emerging Markets ESG Bond USD | Global Emerging Markets Local Debt USD | Global ESG Corporate Bond USD | Global Green Bond USD |
|--|--------------------------------------|--|-------------------------------|-----------------------|
| Bankguthaben   | 1.156.928                            | 41.383.137                             | 4.389.944                     | 852.775               |
| Banküberziehungen                                    | (345.290)                            | (27.439.442)                           | (625.879)                     | (12.640)              |
| Anleihen   | 82.452.548                           | 478.551.386                            | 157.231.373                   | 61.132.054            |
| Zinsswaps  | -                                    | 613.080                                | -                             | -                     |
| Einlagenzertifikate, Schatzwechsel, Commercial Paper | 2.835.031                            | 365.058.461                            | 1.951.429                     | -                     |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere                     | -                                    | -                                      | -                             | -                     |
| <b>Summe</b>   | <b>86.099.217</b>                    | <b>858.166.622</b>                     | <b>162.946.867</b>            | <b>61.972.189</b>     |

|  | Global High Yield Bond USD | Global High Yield ESG Bond USD | Global High Yield Securitised Credit Bond USD | Global Investment Grade Securitised Credit Bond USD |
|--|----------------------------|--------------------------------|---|---|
| Bankguthaben   | 9.149.184                  | 261.788                        | 3.915.677                                     | 10.433.510  |
| Banküberziehungen                                    | (367.875)                  | (10.708)                       | (3.426.738)                                   | (7.321.662)   |
| Anleihen   | 680.648.801                | 32.414.369                     | 2.163.760                                     | 11.134.792  |
| Zinsswaps  | -                          | -                              | -   | -   |
| Einlagenzertifikate, Schatzwechsel, Commercial Paper | -                          | -                              | -   | -   |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere                     | -                          | -                              | 76.128.760                                    | 1.865.871.769                                       |
| <b>Summe</b>   | <b>689.430.110</b>         | <b>32.665.449</b>              | <b>78.781.459</b>                             | <b>1.880.118.409</b>                                |

|  | Global Emerging Markets Corporate Sustainable Bond USD | Global Securitised Credit Bond USD | US High Yield Bond USD | Ultra Short Duration Bond USD |
|--|--|------------------------------------|------------------------|-------------------------------|
| Bankguthaben   | 283.937  | 833.452                            | 111.247                | 5.759.648                     |
| Banküberziehungen                                    | -  | (406.480)                          | (39.925)               | (9.940.147)                   |
| Anleihen   | 140.132.997  | 857.161                            | 39.931.706             | 953.558.034                   |
| Zinsswaps  | -  | -                                  | -                      | -                             |
| Einlagenzertifikate, Schatzwechsel, Commercial Paper | -  | -                                  | -                      | 24.101.413                    |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere                     | -  | 83.464.830                         | -                      | 68.110.262                    |
| <b>Summe</b>   | <b>140.416.934</b>                                     | <b>84.748.963</b>                  | <b>40.003.028</b>      | <b>1.041.589.210</b>          |

|  | US Short Duration High Yield Bond USD | Global Emerging Markets Multi-Asset Income USD | Managed Solutions – Asia Focused Income USD | Multi-Asset Style Factors EUR |
|--|---------------------------------------|--|---|-------------------------------|
| Bankguthaben   | 1.061.438                             | 1.138.798                                      | 5.032.145                                   | 217.425.710                   |
| Banküberziehungen                                    | (197.000)                             | (330.767)                                      | (1.290.686)                                 | (68.551.201)                  |
| Anleihen   | 91.315.312                            | 22.856.328                                     | 156.394.225                                 | -                             |
| Zinsswaps  | -                                     | 10.568   | -   | (3.577.261)                   |
| Einlagenzertifikate, Schatzwechsel, Commercial Paper | -                                     | 7.326.686                                      | -   | 641.168.351                   |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere                     | -                                     | -  | -   | -                             |
| <b>Summe</b>   | <b>92.179.750</b>                     | <b>31.001.613</b>                              | <b>160.135.684</b>                          | <b>786.465.599</b>            |

\* Bis zum 2. Juli 2023 lautete der Name des Teilfonds „Global Short Duration High Yield Bond“.



# Anhang II (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – UK SORP Offenlegung (Fortsetzung)

## Anlagerisiko (Fortsetzung)

### Marktrisiko (Fortsetzung)

#### (iii) Kreditrisiko

Die Gesellschaft ist Kreditrisiken ausgesetzt, da der Teilfonds in forderungsbesicherte Wertpapiere und Anleihen investiert.

#### Analyse des direkten Kreditrisikos

|  | Währung | Investment Grade | Nicht-<br>Investment-<br>Grade | Ohne Rating | Summe         |
|--|---------|------------------|--------------------------------|-------------|---------------|
| Asia ESG Bond                                      | USD     | 18.255.213       | 5.963.668                      | 1.535.708   | 25.754.589    |
| Asia High Yield Bond                               | USD     | 12.835.647       | 523.301.111                    | 109.404.143 | 645.540.901   |
| ESG Short Duration Credit Bond                     | USD     | 2.693.083        | 4.618.729                      | -           | 7.311.812     |
| GEM Debt Total Return                              | USD     | 13.055.033       | 18.291.115                     | 2.305.838   | 33.651.986    |
| Global Bond Total Return                           | USD     | 99.342.843       | 60.809.953                     | 45.356.272  | 205.509.068   |
| Global Emerging Markets Bond                       | USD     | 344.712.172      | 595.369.188                    | 30.565.262  | 970.646.622   |
| Global Emerging Markets Corporate Sustainable Bond | USD     | 24.665.470       | 113.938.070                    | 1.529.457   | 140.132.997   |
| Global Emerging Markets ESG Bond                   | USD     | 34.978.334       | 44.795.609                     | 2.678.605   | 82.452.548    |
| Global Emerging Markets Local Debt                 | USD     | 216.081.549      | 145.006.115                    | 117.463.722 | 478.551.386   |
| Global ESG Corporate Bond                          | USD     | 138.628.043      | 17.455.917                     | 1.147.413   | 157.231.373   |
| Global Green Bond                                  | USD     | 53.788.856       | 3.628.731                      | 3.714.467   | 61.132.054    |
| Global High Yield Bond                             | USD     | 7.368.034        | 663.644.130                    | 9.636.637   | 680.648.801   |
| Global High Yield ESG Bond                         | USD     | 711.177          | 31.390.774                     | 312.418     | 32.414.369    |
| Global High Yield Securitised Credit Bond          | USD     | 8.137.521        | 18.370.642                     | 51.784.357  | 78.292.520    |
| Global Investment Grade Securitised Credit Bond    | USD     | 1.513.270.633    | -                              | 363.735.928 | 1.877.006.561 |
| Global Securitised Credit Bond                     | USD     | 19.771.343       | 13.530.590                     | 51.020.058  | 84.321.991    |
| Ultra Short Duration Bond                          | USD     | 868.911.320      | 55.361.518                     | 94.895.458  | 1.019.168.296 |
| US High Yield Bond                                 | USD     | 1.096.416        | 38.176.377                     | 658.913     | 39.931.706    |
| US Short Duration High Yield Bond <sup>1</sup>     | USD     | 356.207          | 90.383.421                     | 575.684     | 91.315.312    |
| Global Emerging Markets Multi-Asset Income         | USD     | 12.392.352       | 8.149.223                      | 2.314.753   | 22.856.328    |
| Managed Solutions – Asia Focused Income            | USD     | 89.338.076       | 43.394.589                     | 23.661.560  | 156.394.225   |

Das mit den Anleihen verbundene Kreditrisiko wird reduziert durch die Anlage in Staatsanleihen, die ein minimales Kreditrisiko aufweisen, oder in Unternehmensanleihen mit einem Rating von mindestens Investment Grade. Der Teilfonds investiert auch in High-Yield- und Schwellenmarktanleihen ohne Investment-Grade-Rating. Um das damit verbundene Kreditrisiko zu steuern, weist der Teilfonds den Anlageverwalter an, das Portfolio zu streuen, damit die Auswirkungen des Zahlungsausfalls eines Emittenten gering bleiben.

<sup>1</sup> Bis zum 2. Juli 2023 lautete der Name des Teilfonds „Global Short Duration High Yield Bond“.

# Anhang II (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – UK SORP Offenlegung (Fortsetzung)

## Anlagerisiko (Fortsetzung)

### Marktrisiko (Fortsetzung)

#### (iv) Sonstiges Preisrisiko

Das sonstige Preisrisiko bezeichnet das Risiko, dass der Marktwert oder die künftigen Cashflows eines finanziellen Vermögenswerts aufgrund von Marktpreisänderungen (die sich nicht aus dem Zins- oder Währungsrisiko ergeben) schwanken, gleich ob die Änderungen auf das jeweilige Finanzinstrument selbst oder seinen Emittenten zurückgehen oder auch alle ähnlichen Finanzinstrumente desselben Marktes betreffen.

Das sonstige Preisrisiko entsteht vorwiegend in Bezug auf das renditeorientierte Portfolio des Teilfonds. Dieses umfasst Aktien, Depositary Receipts, Optionsscheine/aktiengebundene Wertpapiere, Vorzugsaktien und Organismen für gemeinsame Anlagen.

Der Teilfonds verwaltet dieses sonstige Preisrisiko durch die Zusammenstellung eines diversifizierten Portfolios aus Anlagen in verschiedenen Märkten.

Zum Ende des Geschäftsjahres hatte der Teilfonds folgendes Engagement in Anlagen, die einem sonstigen Preisrisiko unterliegen:

| China A-Shares Equity                |  | USD         |
|--------------------------------------|--|-------------|
| <b>Direkt</b>                        |  |             |
| Aktien                               |  | 23.597.253  |
| <b>Indirekt</b>                      |  |             |
| Organismen für gemeinsame Anlagen    |  | 204.642     |
| Global Emerging Markets Equity       |  | USD         |
| <b>Direkt</b>                        |  |             |
| Aktien                               |  | 353.410.920 |
| Depositary Receipts                  |  | 8.552.421   |
| Global Equity Climate Change         |  | USD         |
| <b>Direkt</b>                        |  |             |
| Aktien                               |  | 308.360.947 |
| Global Equity Sustainable Healthcare |  | USD         |
| <b>Direkt</b>                        |  |             |
| Aktien                               |  | 281.794.794 |
| Depositary Receipts                  |  | 5.670.974   |
| Global Infrastructure Equity         |  | USD         |
| <b>Direkt</b>                        |  |             |
| Aktien                               |  | 856.290.611 |
| Depositary Receipts                  |  | 24.283.875  |

# Anhang II (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – UK SORP Offenlegung (Fortsetzung)

## Anlagerisiko (Fortsetzung)

### Marktrisiko (Fortsetzung)

#### (iv) Sonstiges Preisrisiko (Fortsetzung)

| Global Lower Carbon Equity          |             | USD |
|-------------------------------------|-------------|-----|
| <b>Direkt</b>                       |             |     |
| Aktien                              | 366.932.547 |     |
| Vorzugsaktien                       | 761.140     |     |
| <b>Indirekt</b>                     |             |     |
| Organismen für gemeinsame Anlagen   | 223.843     |     |
| Global Sustainable Equity Income    |             | USD |
| <b>Direkt</b>                       |             |     |
| Aktien                              | 241.711.259 |     |
| Vorzugsaktien                       | 861.510     |     |
| <b>Indirekt</b>                     |             |     |
| Organismen für gemeinsame Anlagen   | 1.934.561   |     |
| Global Sustainable Long Term Equity |             | USD |
| <b>Direkt</b>                       |             |     |
| Aktien                              | 106.984.687 |     |
| Frontier Markets                    |             | USD |
| <b>Direkt</b>                       |             |     |
| Aktien                              | 369.541.270 |     |
| Depositary Receipts                 | 74.853.480  |     |
| Vorzugsaktien                       | 1.458.176   |     |
| Global Real Estate Equity           |             | USD |
| <b>Direkt</b>                       |             |     |
| Aktien                              | 587.172.563 |     |
| <b>Indirekt</b>                     |             |     |
| Organismen für gemeinsame Anlagen   | 47.342.331  |     |

# Anhang II (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – UK SORP Offenlegung (Fortsetzung)

## Anlagerisiko (Fortsetzung)

### Marktrisiko (Fortsetzung)

#### (iv) Sonstiges Preisrisiko (Fortsetzung)

|                                    |            |
|------------------------------------|------------|
| Asia ESG Bond                      | USD        |
| <b>Indirekt</b>                    |            |
| Organismen für gemeinsame Anlagen  | 75.756     |
| Asia High Yield Bond               | USD        |
| <b>Indirekt</b>                    |            |
| Organismen für gemeinsame Anlagen  | 4.986.456  |
| ESG Short Duration Credit Bond     | USD        |
| <b>Indirekt</b>                    |            |
| Organismen für gemeinsame Anlagen  | 85.623     |
| GEM Debt Total Return              | USD        |
| <b>Indirekt</b>                    |            |
| Organismen für gemeinsame Anlagen  | 2.791      |
| Global Bond Total Return           | USD        |
| <b>Indirekt</b>                    |            |
| Organismen für gemeinsame Anlagen  | 7.878.722  |
| Global Emerging Markets Bonds      | USD        |
| <b>Indirekt</b>                    |            |
| Organismen für gemeinsame Anlagen  | 42.400.846 |
| Global Emerging Markets Local Debt | USD        |
| <b>Indirekt</b>                    |            |
| Organismen für gemeinsame Anlagen  | 74.117.806 |

# Anhang II (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – UK SORP Offenlegung (Fortsetzung)

## Anlagerisiko (Fortsetzung)

### Marktrisiko (Fortsetzung)

#### (iv) Sonstiges Preisrisiko (Fortsetzung)

|   |            |
|---|------------|
| Global ESG Corporate Bond                       | USD        |
| <b>Indirekt</b>                                 |            |
| Organismen für gemeinsame Anlagen               | 17.880.547 |
| Global High Yield Bond                          | USD        |
| <b>Indirekt</b>                                 |            |
| Organismen für gemeinsame Anlagen               | 34.823.280 |
| Global High Yield ESG Bond                      | USD        |
| <b>Indirekt</b>                                 |            |
| Organismen für gemeinsame Anlagen               | 1.934.984  |
| Global High Yield Securitised Credit Bond       | USD        |
| <b>Indirekt</b>                                 |            |
| Organismen für gemeinsame Anlagen               | 1.833.022  |
| Global Investment Grade Securitised Credit Bond | USD        |
| <b>Indirekt</b>                                 |            |
| Organismen für gemeinsame Anlagen               | 58.186.980 |
| Global Securitised Credit Bond                  | USD        |
| <b>Indirekt</b>                                 |            |
| Organismen für gemeinsame Anlagen               | 5.297.850  |
| Ultra Short Duration Bond                       | USD        |
| <b>Indirekt</b>                                 |            |
| Organismen für gemeinsame Anlagen               | 45.509.238 |

# Anhang II (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – UK SORP Offenlegung (Fortsetzung)

## Anlagerisiko (Fortsetzung)

### Marktrisiko (Fortsetzung)

#### (iv) Sonstiges Preisrisiko (Fortsetzung)

|  |            |
|--|------------|
| US High Yield Bond                             |            |
|  | USD        |
| <b>Indirekt</b>                                |            |
| Organismen für gemeinsame Anlagen              | 1.779.004  |
| US Short Duration High Yield Bond <sup>1</sup> |            |
|  | USD        |
| <b>Indirekt</b>                                |            |
| Organismen für gemeinsame Anlagen              | 1.442.997  |
| Global Emerging Markets Multi-Asset Income     |            |
|  | USD        |
| <b>Direkt</b>                                  |            |
| Aktien   | 8.424.674  |
| Depository Receipts                            | 187.058    |
| Vorzugsaktien                                  | 177.316    |
| <b>Indirekt</b>                                |            |
| Organismen für gemeinsame Anlagen              | 8.092.053  |
| Managed Solutions – Asia Focused Income        |            |
|  | USD        |
| <b>Direkt</b>                                  |            |
| Aktien   | 82.374.970 |
| Depository Receipts                            | 3.031.927  |
| Vorzugsaktien                                  | 4.654.508  |
| <b>Indirekt</b>                                |            |
| Organismen für gemeinsame Anlagen              | 27.455.371 |
| Multi-Asset Style Factors                      |            |
|  | EUR        |
| <b>Indirekt</b>                                |            |
| Organismen für gemeinsame Anlagen              | 44.465.986 |

<sup>1</sup> Bis zum 2. Juli 2023 lautete der Name des Teilfonds „Global Short Duration High Yield Bond“.

# Anhang II (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – UK SORP Offenlegung (Fortsetzung)

## Anlagerisiko (Fortsetzung)

### Zeitwerthierarchie

Der beizulegende Zeitwert der Finanzinstrumente wurde unter Verwendung der Zeitwerthierarchie ermittelt:

Kategorie (a) Notierte Marktkurse auf einem aktiven Markt für ein identisches Instrument.

Kategorie (b) Wenn keine notierten Marktkurse zur Verfügung stehen, wird der bei einer kürzlich erfolgten Transaktion verwendete Kurs für ein identisches Instrument verwendet und ggf. angepasst.

Kategorie (c) Wenn keine notierten Marktkurse zur Verfügung stehen und kürzlich erfolgte Transaktionen mit einem identischen Instrument allein keinen guten Schätzwert für den beizulegenden Zeitwert darstellen, wird der beizulegende Zeitwert mithilfe einer Bewertungstechnik ermittelt, die auf folgenden Faktoren basiert:

- c (i) beobachtbaren Marktdaten; oder
- c (ii) nicht beobachtbaren Daten.

Zur Bestimmung des beizulegenden Zeitwerts des Anlagevermögens und der Verbindlichkeiten des Teilfonds wurden die obigen Hierarchie-Kategorien folgendermaßen verwendet:

| Teilfonds  | Währung | Kategorie (a) | Kategorie (b) | Kategorie c (i) | Kategorie c (ii) | Summe         |
|--|---------|---------------|---------------|-----------------|------------------|---------------|
| Asia ESG Bond                                      | USD     | 25.754.589    | 74.113        | -               | -                | 25.828.702    |
| Asia High Yield Bond                               | USD     | 637.730.803   | 11.818.983    | -               | -                | 649.549.786   |
| China A-Shares Equity                              | USD     | 23.597.128    | 204.642       | -               | -                | 23.801.770    |
| ESG Short Duration Credit Bond                     | USD     | 7.312.199     | 57.794        | -               | -                | 7.369.993     |
| Frontier Markets                                   | USD     | 441.353.721   | 4.499.205     | -               | -                | 445.852.926   |
| Global Bond Total Return                           | USD     | 204.190.811   | 8.542.510     | -               | -                | 212.733.321   |
| GEM Debt Total Return                              | USD     | 33.514.854    | (257.537)     | -               | -                | 33.257.317    |
| Global Emerging Markets Bond                       | USD     | 957.877.346   | 50.344.876    | -               | -                | 1.008.222.222 |
| Global Emerging Markets Corporate Sustainable Bond | USD     | 138.253.861   | 1.924.187     | -               | -                | 140.178.048   |
| Global Emerging Markets Equity                     | USD     | 361.963.341   | -             | -               | -                | 361.963.341   |
| Global Emerging Markets ESG Bond                   | USD     | 85.065.553    | (281.979)     | -               | -                | 84.783.574    |
| Global Emerging Markets Local Debt                 | USD     | 823.337.736   | 86.049.561    | -               | -                | 909.387.297   |
| Global Emerging Markets Multi-Asset Income         | USD     | 38.279.377    | 8.509.831     | -               | -                | 46.789.208    |
| Global Equity Climate Change                       | USD     | 308.360.947   | (7.802)       | -               | -                | 308.353.145   |
| Global Equity Sustainable Healthcare               | USD     | 287.465.768   | (76.036)      | -               | -                | 287.389.732   |
| Global ESG Corporate Bond                          | USD     | 159.211.528   | 17.828.192    | -               | -                | 177.039.720   |
| Global Green Bond                                  | USD     | 61.132.054    | 40.615        | -               | -                | 61.172.669    |
| Global High Yield Bond                             | USD     | 679.806.531   | 33.704.570    | -               | -                | 713.511.101   |
| Global High Yield ESG Bond                         | USD     | 32.420.766    | 1.850.086     | -               | -                | 34.270.852    |
| Global High Yield Securitised Credit Bond          | USD     | 72.963.626    | 7.101.435     | -               | -                | 80.065.061    |
| Global Infrastructure Equity                       | USD     | 880.574.486   | (167.324)     | -               | -                | 880.407.162   |
| Global Investment Grade Securitised Credit Bond    | USD     | 1.742.497.064 | 186.564.807   | -               | -                | 1.929.061.871 |
| Global Lower Carbon Equity                         | USD     | 367.819.919   | 223.843       | -               | -                | 368.043.762   |
| Global Real Estate Equity                          | USD     | 587.172.563   | 47.341.367    | -               | -                | 634.513.930   |
| Global Securitised Credit Bond                     | USD     | 80.999.258    | 8.426.420     | -               | -                | 89.425.678    |
| Global Sustainable Equity Income                   | USD     | 242.616.659   | 1.934.561     | -               | -                | 244.551.220   |
| Global Sustainable Long Term Equity                | USD     | 106.984.687   | -             | -               | -                | 106.984.687   |
| Managed Solutions – Asia Focused Income            | USD     | 244.033.553   | 29.229.014    | -               | -                | 273.262.567   |
| Multi-Asset Style Factors                          | EUR     | 648.299.163   | 45.876.144    | -               | -                | 694.175.307   |
| Ultra Short Duration Bond                          | USD     | 1.029.165.848 | 55.942.338    | -               | -                | 1.085.108.186 |
| US High Yield Bond                                 | USD     | 39.934.737    | 1.741.057     | -               | -                | 41.675.794    |
| US Short Duration High Yield Bond <sup>1</sup>     | USD     | 91.315.312    | 1.217.351     | -               | -                | 92.532.663    |

<sup>1</sup> Bis zum 2. Juli 2023 lautete der Name des Teilfonds „Global Short Duration High Yield Bond“.

# Anhang III (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Handelstage des Fonds

Die Anteile der Gesellschaft werden an sämtlichen Geschäftstagen gehandelt (mit Ausnahme von Tagen, die in einen Zeitraum fallen, in dem der Handel mit den Anteilen ausgesetzt wurde), und zwar unter der Voraussetzung, dass in Bezug auf jeden Teilfonds ein solcher Geschäftstag ein Tag ist, an dem Börsen und geregelte Märkte in Ländern, in denen wesentlich mit dem Teilfonds gehandelt wird, für den normalen Handel geöffnet sind.

Die Geschäftstage, die keine Handelstage sind, werden in den Jahres- und Halbjahresberichten angegeben, die am Sitz der Gesellschaft angefordert werden können. Jegliche Änderungen dieser Listen sind auch am Sitz der Gesellschaft erhältlich.

Anteilinhaber, die beim Handel auf die Dienste der lokalen Vertriebsstelle oder des Vertreters der Gesellschaft zurückgreifen, sollten zur Kenntnis nehmen, dass es in dem Rechtsraum, in dem ein solcher Händler oder Vertreter tätig ist, an einem Tag, der in diesem Rechtsraum kein Geschäftstag ist, keinen Handel mit den Anteilscheinen des Unternehmens gibt. Anteilinhaber in derartigen Rechtsräumen haben jedoch die Möglichkeit, über die Transferstelle in Luxemburg zu handeln.

Die Gesellschaft legt den Kalender der Tage, an denen Handel stattfindet bzw. nicht stattfindet, in Übereinstimmung mit den neuesten Marktinformationen fest, die die Gesellschaft zu gegebener Zeit erhält. Anteilinhaber können den aktuellsten Handelskalender der Gesellschaft am eingetragenen Sitz der Gesellschaft oder von der lokalen Vertriebsstelle oder vom Repräsentanten der Gesellschaft beziehen.

Die Gesellschaft hat HSBC Investment Funds (Hong Kong) Limited zu ihrem Vertreter und zu ihrer Anteilsvertriebsstelle in Hongkong ernannt. An gesetzlichen Feiertagen und Bankfeiertagen werden in Hongkong keine Anteile der Gesellschaft gehandelt.



# Anhang IV (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Feiertagskalender des Fonds für das Jahr 2024

**ANMERKUNG: DIESER KALENDER DIENT LEDIGLICH ALS ANHALTSPUNKT, DA SICH DIE DATEN IN EINIGEN LÄNDERN ÄNDERN KÖNNEN.**

An den folgenden Tagen wird für keinen der HGIF-Teilfonds ein Nettoinventarwert berechnet:

- an Samstagen und Sonntagen

Des Weiteren wird an den folgenden Tagen für folgende Teilfonds kein NIW berechnet:

#### **ASEAN Equity<sup>1</sup>**

**(Indonesien, Luxemburg, Malaysia, Singapur, Thailand)**

|     |           |   |
|-----|-----------|---|
| 1.  | Januar    | Indonesien, Luxemburg, Malaysia, Singapur, Thailand |
| 25. | Januar    | Malaysia  |
| 1.  | Februar   | Malaysia  |
| 8.  | Februar   | Indonesien  |
| 9.  | Februar   | Indonesien  |
| 12. | Februar   | Malaysia, Singapur                                  |
| 14. | Februar   | Indonesien  |
| 26. | Februar   | Thailand  |
| 11. | März      | Indonesien  |
| 12. | März      | Indonesien  |
| 28. | März      | Malaysia  |
| 29. | März      | Indonesien, Luxemburg, Singapur                     |
| 1.  | April     | Luxemburg   |
| 8.  | April     | Indonesien, Thailand                                |
| 9.  | April     | Indonesien  |
| 10. | April     | Indonesien, Malaysia, Singapur                      |
| 11. | April     | Indonesien, Malaysia                                |
| 12. | April     | Indonesien, Thailand                                |
| 15. | April     | Indonesien, Thailand                                |
| 16. | April     | Thailand  |
| 1.  | Mai       | Indonesien, Luxemburg, Malaysia, Singapur, Thailand |
| 6.  | Mai       | Thailand  |
| 9.  | Mai       | Indonesien, Luxemburg                               |
| 10. | Mai       | Indonesien  |
| 20. | Mai       | Luxemburg   |
| 22. | Mai       | Malaysia, Singapur, Thailand                        |
| 23. | Mai       | Indonesien  |
| 24. | Mai       | Indonesien  |
| 3.  | Juni      | Malaysia, Thailand                                  |
| 17. | Juni      | Indonesien, Malaysia, Singapur                      |
| 18. | Juni      | Indonesien  |
| 8.  | Juli      | Malaysia  |
| 22. | Juli      | Thailand  |
| 29. | Juli      | Thailand  |
| 9.  | August    | Singapur  |
| 12. | August    | Thailand  |
| 15. | August    | Luxemburg   |
| 16. | September | Indonesien, Malaysia                                |
| 17. | September | Malaysia  |
| 14. | Oktober   | Thailand  |
| 23. | Oktober   | Thailand  |
| 31. | Oktober   | Malaysia, Singapur                                  |
| 1.  | November  | Luxemburg   |
| 5.  | Dezember  | Thailand  |
| 10. | Dezember  | Thailand  |
| 25. | Dezember  | Indonesien, Luxemburg, Malaysia, Singapur           |
| 26. | Dezember  | Indonesien, Luxemburg                               |
| 31. | Dezember  | Thailand  |

<sup>1</sup> Bis zum 31. Juli 2023 lautete der Name des Teilfonds „Thai Equity“.

#### **Asia Bond, Asia ESG Bond**

**(Hongkong, Luxemburg)**

|     |           |                     |
|-----|-----------|---------------------|
| 1.  | Januar    | Hongkong, Luxemburg |
| 12. | Februar   | Hongkong            |
| 13. | Februar   | Hongkong            |
| 29. | März      | Hongkong, Luxemburg |
| 1.  | April     | Hongkong, Luxemburg |
| 4.  | April     | Hongkong            |
| 1.  | Mai       | Hongkong, Luxemburg |
| 9.  | Mai       | Luxemburg           |
| 15. | Mai       | Hongkong            |
| 20. | Mai       | Luxemburg           |
| 10. | Juni      | Hongkong            |
| 1.  | Juli      | Hongkong            |
| 15. | August    | Luxemburg           |
| 18. | September | Hongkong            |
| 1.  | Oktober   | Hongkong            |
| 11. | Oktober   | Hongkong            |
| 1.  | November  | Luxemburg           |
| 25. | Dezember  | Hongkong, Luxemburg |
| 26. | Dezember  | Hongkong, Luxemburg |

#### **Asian Currencies Bond**

**(Hongkong, Indonesien, Luxemburg, Malaysia, Singapur, Südkorea, Thailand)**

|     |         |   |
|-----|---------|---|
| 1.  | Januar  | Hongkong, Luxemburg, South Korea          |
| 25. | Januar  | Malaysia                                  |
| 1.  | Februar | Malaysia                                  |
| 8.  | Februar | Indonesien                                |
| 9.  | Februar | Indonesien, Südkorea                      |
| 12. | Februar | Hongkong, Malaysia, Singapur, Südkorea    |
| 13. | Februar | Hongkong                                  |
| 14. | Februar | Indonesien                                |
| 26. | Februar | Thailand                                  |
| 1.  | März    | Südkorea                                  |
| 11. | März    | Indonesien                                |
| 12. | März    | Indonesien                                |
| 28. | März    | Malaysia                                  |
| 29. | März    | Hongkong, Indonesien, Luxemburg, Singapur |
| 1.  | April   | Hongkong, Luxemburg                       |

# Anhang IV (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Feiertagskalender des Fonds für das Jahr 2024 (Fortsetzung)

## Asian Currencies Bond (Fortsetzung)

(Hongkong, Indonesien, Luxemburg, Malaysia, Singapur, Südkorea, Thailand)

|     |           |   |
|-----|-----------|---|
| 4.  | April     | Hongkong  |
| 8.  | April     | Indonesien, Thailand  |
| 9.  | April     | Indonesien  |
| 10. | April     | Indonesien, Malaysia, Singapur, Südkorea                                |
| 11. | April     | Indonesien, Malaysia  |
| 12. | April     | Indonesien, Thailand  |
| 15. | April     | Indonesien, Thailand  |
| 16. | April     | Thailand  |
| 1.  | Mai       | Hongkong, Indonesien, Luxemburg, Malaysia, Singapur, Südkorea, Thailand |
| 6.  | Mai       | Südkorea, Thailand  |
| 9.  | Mai       | Indonesien, Luxemburg   |
| 10. | Mai       | Indonesien  |
| 15. | Mai       | Hongkong, Südkorea  |
| 20. | Mai       | Luxemburg   |
| 22. | Mai       | Malaysia, Singapur, Thailand  |
| 23. | Mai       | Indonesien  |
| 24. | Mai       | Indonesien  |
| 3.  | Juni      | Malaysia, Thailand  |
| 6.  | Juni      | Südkorea  |
| 10. | Juni      | Hongkong  |
| 17. | Juni      | Indonesien, Malaysia, Singapur  |
| 18. | Juni      | Indonesien  |
| 1.  | Juli      | Hongkong  |
| 8.  | Juli      | Malaysia  |
| 22. | Juli      | Thailand  |
| 29. | Juli      | Thailand  |
| 9.  | August    | Singapur  |
| 12. | August    | Thailand  |
| 15. | August    | Südkorea, Luxemburg   |
| 16. | September | Indonesien, Malaysia, Südkorea  |
| 17. | September | Malaysia, Südkorea  |
| 18. | September | Hongkong, Südkorea  |
| 1.  | Oktober   | Hongkong  |
| 3.  | Oktober   | Südkorea  |
| 9.  | Oktober   | Südkorea  |
| 11. | Oktober   | Hongkong  |
| 14. | Oktober   | Thailand  |
| 23. | Oktober   | Thailand  |
| 31. | Oktober   | Malaysia, Singapur  |
| 1.  | November  | Luxemburg   |
| 5.  | Dezember  | Thailand  |
| 10. | Dezember  | Thailand  |
| 25. | Dezember  | Hongkong, Indonesien, Luxemburg, Malaysia, Singapur, Südkorea           |
| 26. | Dezember  | Hongkong, Indonesien, Luxemburg   |
| 31. | Dezember  | Südkorea, Thailand  |

## Asia ex Japan Equity, Asia ex Japan Equity Smaller Companies,

### Asia Pacific ex Japan Equity High Dividend

(Hongkong, Luxemburg)

|     |           |                     |
|-----|-----------|---------------------|
| 1.  | Januar    | Hongkong, Luxemburg |
| 12. | Februar   | Hongkong            |
| 13. | Februar   | Hongkong            |
| 29. | März      | Hongkong, Luxemburg |
| 1.  | April     | Hongkong, Luxemburg |
| 4.  | April     | Hongkong            |
| 1.  | Mai       | Hongkong, Luxemburg |
| 9.  | Mai       | Luxemburg           |
| 15. | Mai       | Hongkong            |
| 20. | Mai       | Luxemburg           |
| 10. | Juni      | Hongkong            |
| 1.  | Juli      | Hongkong            |
| 15. | August    | Luxemburg           |
| 18. | September | Hongkong            |
| 1.  | Oktober   | Hongkong            |
| 11. | Oktober   | Hongkong            |
| 1.  | November  | Luxemburg           |
| 25. | Dezember  | Hongkong, Luxemburg |
| 26. | Dezember  | Hongkong, Luxemburg |

## Asia High Yield Bond

(Hongkong, Luxemburg)

|     |           |                     |
|-----|-----------|---------------------|
| 1.  | Januar    | Hongkong, Luxemburg |
| 12. | Februar   | Hongkong            |
| 13. | Februar   | Hongkong            |
| 29. | März      | Hongkong, Luxemburg |
| 1.  | April     | Hongkong, Luxemburg |
| 4.  | April     | Hongkong            |
| 1.  | Mai       | Hongkong, Luxemburg |
| 9.  | Mai       | Luxemburg           |
| 15. | Mai       | Hongkong            |
| 20. | Mai       | Luxemburg           |
| 10. | Juni      | Hongkong            |
| 1.  | Juli      | Hongkong            |
| 15. | August    | Luxemburg           |
| 18. | September | Hongkong            |
| 1.  | Oktober   | Hongkong            |
| 11. | Oktober   | Hongkong            |
| 1.  | November  | Luxemburg           |
| 25. | Dezember  | Hongkong, Luxemburg |
| 26. | Dezember  | Hongkong, Luxemburg |

# Anhang IV (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Feiertagskalender des Fonds für das Jahr 2024 (Fortsetzung)

## **Brazil Bond**

(Brasilien, Luxemburg, USA\*\*)

|     |           |                           |
|-----|-----------|---------------------------|
| 1.  | Januar    | Brasilien, Luxemburg, USA |
| 15. | Januar    | USA                       |
| 12. | Februar   | Brasilien                 |
| 13. | Februar   | Brasilien                 |
| 19. | Februar   | USA                       |
| 29. | März      | Brasilien, Luxemburg, USA |
| 1.  | April     | Luxemburg                 |
| 1.  | Mai       | Brasilien, Luxemburg      |
| 9.  | Mai       | Luxemburg                 |
| 20. | Mai       | Luxemburg                 |
| 27. | Mai       | USA                       |
| 30. | Mai       | Brasilien                 |
| 19. | Juni      | USA                       |
| 4.  | Juli      | USA                       |
| 15. | August    | Luxemburg                 |
| 2.  | September | USA                       |
| 14. | Oktober   | USA                       |
| 1.  | November  | Luxemburg                 |
| 11. | November  | USA                       |
| 15. | November  | Brasilien                 |
| 20. | November  | Brasilien                 |
| 28. | November  | USA                       |
| 24. | Dezember  | Brasilien                 |
| 25. | Dezember  | Brasilien, Luxemburg, USA |
| 26. | Dezember  | Luxemburg                 |
| 31. | Dezember  | Brasilien                 |

## **Brazil Equity**

(Brasilien, Luxemburg, Vereinigtes Königreich)

|     |          |  |
|-----|----------|--|
| 1.  | Januar   | Brasilien, Luxemburg, USA                    |
| 12. | Februar  | Brasilien                                    |
| 13. | Februar  | Brasilien                                    |
| 29. | März     | Brasilien, Luxemburg, Vereinigtes Königreich |
| 1.  | April    | Luxemburg, Vereinigtes Königreich            |
| 1.  | Mai      | Brasilien, Luxemburg                         |
| 6.  | Mai      | Vereinigtes Königreich                       |
| 9.  | Mai      | Luxemburg                                    |
| 20. | Mai      | Luxemburg                                    |
| 27. | Mai      | Vereinigtes Königreich                       |
| 30. | Mai      | Brasilien                                    |
| 15. | August   | Luxemburg                                    |
| 26. | August   | Vereinigtes Königreich                       |
| 1.  | November | Luxemburg                                    |
| 15. | November | Brasilien                                    |
| 20. | November | Brasilien                                    |
| 24. | Dezember | Brasilien                                    |
| 25. | Dezember | Brasilien, Luxemburg, Vereinigtes Königreich |
| 26. | Dezember | Luxemburg, Vereinigtes Königreich            |
| 31. | Dezember | Brasilien                                    |

## **BRIC Equity, BRIC Markets Equity**

(Brasilien, Hongkong, Indien, Luxemburg, Vereinigtes Königreich)

|     |           |  |
|-----|-----------|--|
| 1.  | Januar    | Brasilien, Hongkong, Indien, Luxemburg, Vereinigtes Königreich |
| 26. | Januar    | Indien   |
| 12. | Februar   | Brasilien, Hongkong  |
| 13. | Februar   | Brasilien, Hongkong  |
| 8.  | März      | Indien   |
| 25. | März      | Indien   |
| 29. | März      | Brasilien, Hongkong, Indien, Luxemburg, Vereinigtes Königreich |
| 1.  | April     | Hongkong, Luxemburg, Vereinigtes Königreich                    |
| 4.  | April     | Hongkong   |
| 11. | April     | Indien   |
| 17. | April     | Indien   |
| 1.  | Mai       | Brasilien, Hongkong, Indien, Luxemburg                         |
| 6.  | Mai       | Vereinigtes Königreich   |
| 9.  | Mai       | Luxemburg  |
| 15. | Mai       | Hongkong   |
| 20. | Mai       | Indien, Luxemburg  |
| 27. | Mai       | Vereinigtes Königreich   |
| 30. | Mai       | Brasilien  |
| 10. | Juni      | Hongkong   |
| 17. | Juni      | Indien   |
| 1.  | Juli      | Hongkong   |
| 17. | Juli      | Indien   |
| 15. | August    | Indien, Luxemburg  |
| 26. | August    | Vereinigtes Königreich   |
| 18. | September | Hongkong   |
| 1.  | Oktober   | Hongkong   |
| 2.  | Oktober   | Indien   |
| 11. | Oktober   | Hongkong   |
| 1.  | November  | Indien, Luxemburg  |
| 15. | November  | Brasilien, Indien  |
| 20. | November  | Brasilien  |
| 24. | Dezember  | Brasilien  |
| 25. | Dezember  | Brasilien, Hongkong, Indien, Luxemburg, Vereinigtes Königreich |
| 26. | Dezember  | Hongkong, Luxemburg, Vereinigtes Königreich                    |
| 31. | Dezember  | Brasilien  |

## **China A-Shares Equity**

(China, Hongkong, Luxemburg)

|     |         |                            |
|-----|---------|----------------------------|
| 1.  | Januar  | China, Hongkong, Luxemburg |
| 9.  | Februar | China                      |
| 12. | Februar | China, Hongkong            |
| 13. | Februar | China, Hongkong            |
| 14. | Februar | China                      |
| 15. | Februar | China                      |
| 16. | Februar | China                      |
| 29. | März    | Hongkong, Luxemburg        |
| 1.  | April   | Hongkong, Luxemburg        |
| 4.  | April   | China, Hongkong            |
| 5.  | April   | China                      |

# Anhang IV (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Feiertagskalender des Fonds für das Jahr 2024 (Fortsetzung)

## China A-shares Equity (Fortsetzung)

(China, Hongkong, Luxemburg)

|     |           |                            |
|-----|-----------|----------------------------|
| 1.  | Mai       | China, Hongkong, Luxemburg |
| 2.  | Mai       | China                      |
| 3.  | Mai       | China                      |
| 9.  | Mai       | Luxemburg                  |
| 15. | Mai       | Hongkong                   |
| 20. | Mai       | Luxemburg                  |
| 10. | Juni      | China, Hongkong            |
| 1.  | Juli      | Hongkong                   |
| 15. | August    | Luxemburg                  |
| 16. | September | China                      |
| 17. | September | China                      |
| 18. | September | Hongkong                   |
| 1.  | Oktober   | China, Hongkong            |
| 2.  | Oktober   | China                      |
| 3.  | Oktober   | China                      |
| 4.  | Oktober   | China                      |
| 7.  | Oktober   | China                      |
| 11. | Oktober   | Hongkong                   |
| 1.  | November  | Luxemburg                  |
| 25. | Dezember  | Hongkong, Luxemburg        |
| 26. | Dezember  | Hongkong, Luxemburg        |

## Chinese Equity

(Hongkong, Luxemburg)

|     |           |                     |
|-----|-----------|---------------------|
| 1.  | Januar    | Hongkong, Luxemburg |
| 12. | Februar   | Hongkong            |
| 13. | Februar   | Hongkong            |
| 29. | März      | Hongkong, Luxemburg |
| 1.  | April     | Hongkong, Luxemburg |
| 4.  | April     | Hongkong            |
| 1.  | Mai       | Hongkong, Luxemburg |
| 9.  | Mai       | Luxemburg           |
| 15. | Mai       | Hongkong, Luxemburg |
| 20. | Mai       | Luxemburg           |
| 10. | Juni      | Hongkong            |
| 1.  | Juli      | Hongkong            |
| 15. | August    | Luxemburg           |
| 18. | September | Hongkong            |
| 1.  | Oktober   | Hongkong            |
| 11. | Oktober   | Hongkong            |
| 1.  | November  | Luxemburg           |
| 25. | Dezember  | Hongkong, Luxemburg |
| 26. | Dezember  | Hongkong, Luxemburg |

## Corporate Euro Bond Fixed Term 2027 (aufgelegt zum 30. Juni 2023)

(Frankreich, Luxemburg, Vereinigtes Königreich)

|     |          |   |
|-----|----------|---|
| 1.  | Januar   | Frankreich, Luxemburg, Vereinigtes Königreich |
| 29. | März     | Frankreich, Luxemburg, Vereinigtes Königreich |
| 1.  | April    | Frankreich, Luxemburg, Vereinigtes Königreich |
| 1.  | Mai      | Frankreich, Luxemburg                         |
| 6.  | Mai      | Vereinigtes Königreich                        |
| 9.  | Mai      | Luxemburg                                     |
| 20. | Mai      | Luxemburg                                     |
| 27. | Mai      | Vereinigtes Königreich                        |
| 15. | August   | Luxemburg                                     |
| 26. | August   | Vereinigtes Königreich                        |
| 1.  | November | Luxemburg                                     |
| 25. | Dezember | Frankreich, Luxemburg, Vereinigtes Königreich |
| 26. | Dezember | Frankreich, Luxemburg, Vereinigtes Königreich |

## Economic Scale US Equity

(Luxemburg, Vereinigtes Königreich, USA)

|     |           |  |
|-----|-----------|--|
| 1.  | Januar    | Luxemburg, Vereinigtes Königreich, USA |
| 15. | Januar    | USA                                    |
| 19. | Februar   | USA                                    |
| 29. | März      | Luxemburg, Vereinigtes Königreich, USA |
| 1.  | April     | Luxemburg, Vereinigtes Königreich      |
| 1.  | Mai       | Luxemburg                              |
| 6.  | Mai       | Vereinigtes Königreich                 |
| 9.  | Mai       | Luxemburg                              |
| 20. | Mai       | Luxemburg                              |
| 27. | Mai       | Vereinigtes Königreich, USA            |
| 19. | Juni      | USA                                    |
| 4.  | Juli      | USA                                    |
| 15. | August    | Luxemburg                              |
| 26. | August    | Vereinigtes Königreich                 |
| 2.  | September | USA                                    |
| 1.  | November  | Luxemburg                              |
| 28. | November  | USA                                    |
| 25. | Dezember  | Luxemburg, Vereinigtes Königreich, USA |
| 26. | Dezember  | Luxemburg, Vereinigtes Königreich      |

## ESG Short Duration Credit Bond

(Luxemburg, USA)

|     |           |                |
|-----|-----------|----------------|
| 1.  | Januar    | Luxemburg, USA |
| 15. | Januar    | USA            |
| 19. | Februar   | USA            |
| 29. | März      | Luxemburg, USA |
| 1.  | April     | Luxemburg      |
| 1.  | Mai       | Luxemburg      |
| 9.  | Mai       | Luxemburg      |
| 20. | Mai       | Luxemburg      |
| 27. | Mai       | USA            |
| 19. | Juni      | USA            |
| 4.  | Juli      | USA            |
| 15. | August    | Luxemburg      |
| 2.  | September | USA            |

# Anhang IV (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Feiertagskalender des Fonds für das Jahr 2024 (Fortsetzung)

## ESG Short Duration Credit Bond (Fortsetzung)

(Luxemburg, USA)

|     |          |                |
|-----|----------|----------------|
| 14. | Oktober  | USA            |
| 1.  | November | Luxemburg      |
| 11. | November | USA            |
| 28. | November | USA            |
| 25. | Dezember | Luxemburg, USA |
| 26. | Dezember | Luxemburg      |

## Euro Bond, Euro Credit Bond,

### Euro Bond Total Return, Euro High Yield Bond

(Luxemburg, Vereinigtes Königreich)

|     |          |                                   |
|-----|----------|-----------------------------------|
| 1.  | Januar   | Luxemburg, Vereinigtes Königreich |
| 29. | März     | Luxemburg, Vereinigtes Königreich |
| 1.  | April    | Luxemburg, Vereinigtes Königreich |
| 1.  | Mai      | Luxemburg                         |
| 6.  | Mai      | Vereinigtes Königreich            |
| 9.  | Mai      | Luxemburg                         |
| 20. | Mai      | Luxemburg                         |
| 27. | Mai      | Vereinigtes Königreich            |
| 15. | August   | Luxemburg                         |
| 26. | August   | Vereinigtes Königreich            |
| 1.  | November | Luxemburg                         |
| 25. | Dezember | Luxemburg, Vereinigtes Königreich |
| 26. | Dezember | Luxemburg, Vereinigtes Königreich |

## Euroland Value, Euroland Equity Smaller Companies,

### Euroland Growth, Europe Value

(Frankreich, Luxemburg)

|     |          |                       |
|-----|----------|-----------------------|
| 1.  | Januar   | Frankreich, Luxemburg |
| 29. | März     | Frankreich, Luxemburg |
| 1.  | April    | Frankreich, Luxemburg |
| 1.  | Mai      | Frankreich, Luxemburg |
| 9.  | Mai      | Luxemburg             |
| 20. | Mai      | Luxemburg             |
| 15. | August   | Luxemburg             |
| 1.  | November | Luxemburg             |
| 25. | Dezember | Frankreich, Luxemburg |
| 26. | Dezember | Frankreich, Luxemburg |

## Frontier Markets (Hinweis: Fonds wird freitags nicht gehandelt)

(Luxemburg, Vereinigtes Königreich, Andere\*)

|     |           |   |
|-----|-----------|---|
| 1.  | Januar    | Luxemburg, Vereinigtes Königreich, Andere |
| 13. | Februar   | Andere                                    |
| 29. | März      | Luxemburg                                 |
| 1.  | April     | Luxemburg, Vereinigtes Königreich         |
| 9.  | April     | Andere                                    |
| 10. | April     | Andere                                    |
| 11. | April     | Andere                                    |
| 1.  | Mai       | Luxemburg, Andere                         |
| 6.  | Mai       | Vereinigtes Königreich                    |
| 9.  | Mai       | Luxemburg                                 |
| 20. | Mai       | Luxemburg                                 |
| 27. | Mai       | Vereinigtes Königreich                    |
| 17. | Juni      | Andere                                    |
| 18. | Juni      | Andere                                    |
| 19. | Juni      | Andere                                    |
| 15. | August    | Luxemburg                                 |
| 26. | August    | Vereinigtes Königreich                    |
| 16. | September | Andere                                    |
| 1.  | November  | Luxemburg                                 |
| 25. | Dezember  | Luxemburg, Vereinigtes Königreich, Andere |
| 26. | Dezember  | Luxemburg, Vereinigtes Königreich         |

## GEM Debt Total Return

(Luxemburg, USA\*\*)

|     |           |                |
|-----|-----------|----------------|
| 1.  | Januar    | Luxemburg, USA |
| 15. | Januar    | USA            |
| 19. | Februar   | USA            |
| 29. | März      | Luxemburg, USA |
| 1.  | April     | Luxemburg      |
| 1.  | Mai       | Luxemburg      |
| 9.  | Mai       | Luxemburg      |
| 20. | Mai       | Luxemburg      |
| 27. | Mai       | USA            |
| 19. | Juni      | USA            |
| 4.  | Juli      | USA            |
| 15. | August    | Luxemburg      |
| 2.  | September | USA            |
| 14. | Oktober   | USA            |
| 1.  | November  | Luxemburg      |
| 11. | November  | USA            |
| 28. | November  | USA            |
| 25. | Dezember  | Luxemburg, USA |
| 26. | Dezember  | Luxemburg      |

# Anhang IV (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Feiertagskalender des Fonds für das Jahr 2024 (Fortsetzung)

## **Global Investment Grade Securitised Credit Bond**

(Australien, Frankreich, Deutschland, Italien, Luxemburg, Vereinigtes Königreich, USA\*\*)

|     |           |  |
|-----|-----------|--|
| 1.  | Januar    | Australien, Frankreich, Deutschland, Italien, Luxemburg, Vereinigtes Königreich, USA |
| 15. | Januar    | USA  |
| 26. | Januar    | Australien   |
| 19. | Februar   | USA  |
| 29. | März      | Australien, Frankreich, Deutschland, Italien, Luxemburg, Vereinigtes Königreich, USA |
| 1.  | April     | Australien, Frankreich, Deutschland, Italien, Luxemburg, Vereinigtes Königreich      |
| 25. | April     | Australien   |
| 1.  | Mai       | Frankreich, Deutschland, Italien, Luxemburg  |
| 6.  | Mai       | Vereinigtes Königreich   |
| 9.  | Mai       | Luxemburg  |
| 20. | Mai       | Luxemburg  |
| 27. | Mai       | Vereinigtes Königreich, USA  |
| 10. | Juni      | Australien   |
| 19. | Juni      | USA  |
| 4.  | Juli      | USA  |
| 15. | August    | Italien, Luxemburg   |
| 26. | August    | Vereinigtes Königreich   |
| 2.  | September | USA  |
| 14. | Oktober   | USA  |
| 1.  | November  | Luxemburg  |
| 11. | November  | USA  |
| 28. | November  | USA  |
| 24. | Dezember  | Deutschland, Italien   |
| 25. | Dezember  | Australien, Frankreich, Deutschland, Italien, Luxemburg, Vereinigtes Königreich, USA |
| 26. | Dezember  | Australien, Frankreich, Deutschland, Italien, Luxemburg, Vereinigtes Königreich      |
| 31. | Dezember  | Deutschland, Italien   |

## **Global Securitised Credit Bond\*\*\***

(Deutschland, Luxemburg, Vereinigtes Königreich, USA\*\*)

|     |           |   |
|-----|-----------|---|
| 1.  | Januar    | Deutschland, Luxemburg, Vereinigtes Königreich, USA |
| 15. | Januar    | USA   |
| 19. | Februar   | USA   |
| 29. | März      | Luxemburg   |
| 1.  | April     | Deutschland, Luxemburg, Vereinigtes Königreich      |
| 1.  | Mai       | Luxemburg   |
| 6.  | Mai       | Vereinigtes Königreich                              |
| 9.  | Mai       | Luxemburg   |
| 20. | Mai       | Luxemburg   |
| 27. | Mai       | Vereinigtes Königreich, USA                         |
| 15. | August    | Luxemburg   |
| 26. | August    | Vereinigtes Königreich                              |
| 2.  | September | USA   |
| 14. | Oktober   | USA   |
| 1.  | November  | Luxemburg   |
| 11. | November  | USA   |
| 25. | Dezember  | Luxemburg   |
| 26. | Dezember  | Luxemburg   |

## **Global High Yield Securitised Credit Bond\*\*\***

(Australien, Frankreich, Deutschland, Italien, Luxemburg, Vereinigtes Königreich, USA\*\*)

|     |           |  |
|-----|-----------|--|
| 1.  | Januar    | Australien, Frankreich, Deutschland, Italien, Luxemburg, Vereinigtes Königreich, USA |
| 15. | Januar    | USA  |
| 19. | Februar   | USA  |
| 29. | März      | Luxemburg  |
| 1.  | April     | Australien, Frankreich, Deutschland, Italien, Luxemburg, Vereinigtes Königreich      |
| 1.  | Mai       | Luxemburg  |
| 6.  | Mai       | Vereinigtes Königreich   |
| 9.  | Mai       | Luxemburg  |
| 20. | Mai       | Luxemburg  |
| 27. | Mai       | Vereinigtes Königreich, USA  |
| 10. | Juni      | Australien   |
| 15. | August    | Luxemburg  |
| 26. | August    | Vereinigtes Königreich   |
| 2.  | September | USA  |
| 14. | Oktober   | USA  |
| 1.  | November  | Luxemburg  |
| 11. | November  | USA  |
| 25. | Dezember  | Luxemburg  |
| 26. | Dezember  | Luxemburg  |

# Anhang IV (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Feiertagskalender des Fonds für das Jahr 2024 (Fortsetzung)

## Global Bond

(Japan, Luxemburg, Vereinigtes Königreich, USA\*\*)

|     |           |   |
|-----|-----------|---|
| 1.  | Januar    | Japan, Luxemburg, Vereinigtes Königreich, USA |
| 2.  | Januar    | Japan   |
| 3.  | Januar    | Japan   |
| 8.  | Januar    | Japan   |
| 15. | Januar    | USA   |
| 12. | Februar   | Japan   |
| 19. | Februar   | USA   |
| 23. | Februar   | Japan   |
| 20. | März      | Japan   |
| 29. | März      | Luxemburg, Vereinigtes Königreich, USA        |
| 1.  | April     | Luxemburg, Vereinigtes Königreich             |
| 29. | April     | Japan   |
| 1.  | Mai       | Luxemburg                                     |
| 3.  | Mai       | Japan   |
| 6.  | Mai       | Japan, Vereinigtes Königreich                 |
| 9.  | Mai       | Luxemburg                                     |
| 20. | Mai       | Luxemburg                                     |
| 27. | Mai       | Vereinigtes Königreich, USA                   |
| 19. | Juni      | USA   |
| 4.  | Juli      | USA   |
| 15. | Juli      | Japan   |
| 12. | August    | Japan   |
| 15. | August    | Luxemburg                                     |
| 26. | August    | Vereinigtes Königreich                        |
| 2.  | September | USA   |
| 16. | September | Japan   |
| 23. | September | Japan   |
| 14. | Oktober   | Japan, USA                                    |
| 1.  | November  | Luxemburg                                     |
| 4.  | November  | Japan   |
| 11. | November  | USA   |
| 28. | November  | USA   |
| 25. | Dezember  | Luxemburg, Vereinigtes Königreich, USA        |
| 26. | Dezember  | Luxemburg, Vereinigtes Königreich             |
| 31. | Dezember  | Japan   |

## Global Bond Total Return

(Luxemburg, Vereinigtes Königreich, USA\*\*)

|     |           |  |
|-----|-----------|--|
| 1.  | Januar    | Luxemburg, Vereinigtes Königreich, USA |
| 15. | Januar    | USA                                    |
| 19. | Februar   | USA                                    |
| 29. | März      | Luxemburg, Vereinigtes Königreich, USA |
| 1.  | April     | Luxemburg, Vereinigtes Königreich      |
| 1.  | Mai       | Luxemburg                              |
| 6.  | Mai       | Vereinigtes Königreich                 |
| 9.  | Mai       | Luxemburg                              |
| 20. | Mai       | Luxemburg                              |
| 27. | Mai       | Vereinigtes Königreich, USA            |
| 19. | Juni      | USA                                    |
| 4.  | Juli      | USA                                    |
| 15. | August    | Luxemburg                              |
| 26. | August    | Vereinigtes Königreich                 |
| 2.  | September | USA                                    |
| 14. | Oktober   | USA                                    |
| 1.  | November  | Luxemburg                              |
| 11. | November  | USA                                    |
| 28. | November  | USA                                    |
| 25. | Dezember  | Luxemburg, Vereinigtes Königreich, USA |
| 26. | Dezember  | Luxemburg, Vereinigtes Königreich      |

## Global Corporate Bond

(Frankreich, Luxemburg, USA\*\*)

|     |           |                            |
|-----|-----------|----------------------------|
| 1.  | Januar    | Frankreich, Luxemburg, USA |
| 15. | Januar    | USA                        |
| 19. | Februar   | USA                        |
| 29. | März      | Frankreich, Luxemburg, USA |
| 1.  | April     | Frankreich, Luxemburg      |
| 1.  | Mai       | Frankreich, Luxemburg      |
| 9.  | Mai       | Luxemburg                  |
| 20. | Mai       | Luxemburg                  |
| 27. | Mai       | USA                        |
| 19. | Juni      | USA                        |
| 4.  | Juli      | USA                        |
| 15. | August    | Luxemburg                  |
| 2.  | September | USA                        |
| 14. | Oktober   | USA                        |
| 1.  | November  | Luxemburg                  |
| 11. | November  | USA                        |
| 28. | November  | USA                        |
| 25. | Dezember  | Frankreich, Luxemburg, USA |
| 26. | Dezember  | Frankreich, Luxemburg      |

# Anhang IV (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Feiertagskalender des Fonds für das Jahr 2024 (Fortsetzung)

## Global Credit Floating Rate Fixed Term Bond 2023 – 1 (geschlossen zum 5. Juli 2023)

(Luxemburg, USA\*\*)

|     |           |                |
|-----|-----------|----------------|
| 1.  | Januar    | Luxemburg, USA |
| 15. | Januar    | USA            |
| 19. | Februar   | USA            |
| 29. | März      | Luxemburg, USA |
| 1.  | April     | Luxemburg      |
| 1.  | Mai       | Luxemburg      |
| 9.  | Mai       | Luxemburg      |
| 20. | Mai       | Luxemburg      |
| 27. | Mai       | USA            |
| 19. | Juni      | USA            |
| 4.  | Juli      | USA            |
| 15. | August    | Luxemburg      |
| 2.  | September | USA            |
| 14. | Oktober   | USA            |
| 1.  | November  | Luxemburg      |
| 11. | November  | USA            |
| 28. | November  | USA            |
| 25. | Dezember  | Luxemburg, USA |
| 26. | Dezember  | Luxemburg      |

## Global Credit Floating Rate Fixed Term Bond 2023 – 2

(Geschlossen zum 29. Dezember 2023)

(Luxemburg, USA\*\*)

|     |           |                |
|-----|-----------|----------------|
| 1.  | Januar    | Luxemburg, USA |
| 15. | Januar    | USA            |
| 19. | Februar   | USA            |
| 29. | März      | Luxemburg, USA |
| 1.  | April     | Luxemburg      |
| 1.  | Mai       | Luxemburg      |
| 9.  | Mai       | Luxemburg      |
| 20. | Mai       | Luxemburg      |
| 27. | Mai       | USA            |
| 19. | Juni      | USA            |
| 4.  | Juli      | USA            |
| 15. | August    | Luxemburg      |
| 2.  | September | USA            |
| 14. | Oktober   | USA            |
| 1.  | November  | Luxemburg      |
| 11. | November  | USA            |
| 28. | November  | USA            |
| 25. | Dezember  | Luxemburg, USA |
| 26. | Dezember  | Luxemburg      |

## Global Emerging Markets Bond, Global Emerging Markets ESG Bond,

Global Emerging Markets Local Debt

(Luxemburg, USA\*\*)

|     |           |                |
|-----|-----------|----------------|
| 1.  | Januar    | Luxemburg, USA |
| 15. | Januar    | USA            |
| 19. | Februar   | USA            |
| 29. | März      | Luxemburg, USA |
| 1.  | April     | Luxemburg      |
| 1.  | Mai       | Luxemburg      |
| 9.  | Mai       | Luxemburg      |
| 20. | Mai       | Luxemburg      |
| 27. | Mai       | USA            |
| 19. | Juni      | USA            |
| 4.  | Juli      | USA            |
| 15. | August    | Luxemburg      |
| 2.  | September | USA            |
| 14. | Oktober   | USA            |
| 1.  | November  | Luxemburg      |
| 11. | November  | USA            |
| 28. | November  | USA            |
| 25. | Dezember  | Luxemburg, USA |
| 26. | Dezember  | Luxemburg      |

## Global Emerging Markets Corporate Sustainable Bond

(Brasilien, Luxemburg, Mexiko)

|     |           |                              |
|-----|-----------|------------------------------|
| 1.  | Januar    | Brasilien, Luxemburg, Mexiko |
| 5.  | Februar   | Mexiko                       |
| 12. | Februar   | Brasilien                    |
| 13. | Februar   | Brasilien                    |
| 18. | März      | Mexiko                       |
| 29. | März      | Brasilien, Luxemburg, Mexiko |
| 1.  | April     | Luxemburg                    |
| 1.  | Mai       | Brasilien, Luxemburg, Mexiko |
| 9.  | Mai       | Luxemburg                    |
| 20. | Mai       | Luxemburg                    |
| 30. | Mai       | Brasilien                    |
| 15. | August    | Luxemburg                    |
| 16. | September | Mexiko                       |
| 1.  | Oktober   | Mexiko                       |
| 1.  | November  | Luxemburg                    |
| 15. | November  | Brasilien                    |
| 18. | November  | Mexiko                       |
| 20. | November  | Brasilien                    |
| 12. | Dezember  | Mexiko                       |
| 24. | Dezember  | Brasilien                    |
| 25. | Dezember  | Brasilien, Luxemburg, Mexiko |
| 26. | Dezember  | Luxemburg                    |
| 31. | Dezember  | Brasilien                    |



# Anhang IV (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Feiertagskalender des Fonds für das Jahr 2024 (Fortsetzung)

## Global Emerging Markets Equity

(Hongkong, Luxemburg, Vereinigtes Königreich, Andere\*)

|     |           |   |
|-----|-----------|---|
| 1.  | Januar    | Hongkong, Luxemburg, Andere, Vereinigtes Königreich |
| 9.  | Februar   | Andere  |
| 12. | Februar   | Hongkong, Andere                                    |
| 13. | Februar   | Hongkong, Andere                                    |
| 14. | Februar   | Andere  |
| 29. | März      | Hongkong, Luxemburg, Andere, Vereinigtes Königreich |
| 1.  | April     | Hongkong, Luxemburg, Vereinigtes Königreich         |
| 4.  | April     | Hongkong, Andere                                    |
| 5.  | April     | Andere  |
| 10. | April     | Andere  |
| 1.  | Mai       | Hongkong, Luxemburg, Andere                         |
| 6.  | Mai       | Vereinigtes Königreich                              |
| 9.  | Mai       | Luxemburg   |
| 15. | Mai       | Hongkong  |
| 20. | Mai       | Luxemburg   |
| 27. | Mai       | Vereinigtes Königreich                              |
| 10. | Juni      | Hongkong, Andere                                    |
| 17. | Juni      | Andere  |
| 1.  | Juli      | Hongkong  |
| 15. | August    | Luxemburg, Andere                                   |
| 26. | August    | Vereinigtes Königreich                              |
| 16. | September | Andere  |
| 17. | September | Andere  |
| 18. | September | Hongkong  |
| 1.  | Oktober   | Hongkong  |
| 2.  | Oktober   | Andere  |
| 11. | Oktober   | Hongkong  |
| 1.  | November  | Luxemburg   |
| 25. | Dezember  | Hongkong, Luxemburg, Andere, Vereinigtes Königreich |
| 26. | Dezember  | Hongkong, Luxemburg, Vereinigtes Königreich         |

## Global Emerging Markets ESG Local Debt

(Luxemburg, USA\*\*)

|     |           |                |
|-----|-----------|----------------|
| 1.  | Januar    | Luxemburg, USA |
| 15. | Januar    | USA            |
| 19. | Februar   | USA            |
| 29. | März      | Luxemburg, USA |
| 1.  | April     | Luxemburg      |
| 1.  | Mai       | Luxemburg      |
| 9.  | Mai       | Luxemburg      |
| 20. | Mai       | Luxemburg      |
| 27. | Mai       | USA            |
| 19. | Juni      | USA            |
| 4.  | Juli      | USA            |
| 15. | August    | Luxemburg      |
| 2.  | September | USA            |
| 14. | Oktober   | USA            |
| 1.  | November  | Luxemburg      |
| 11. | November  | USA            |
| 28. | November  | USA            |
| 25. | Dezember  | Luxemburg, USA |
| 26. | Dezember  | Luxemburg      |

## Global Emerging Markets Multi-Asset Income

(Hongkong, Luxemburg, Vereinigtes Königreich, USA\*\*)

|     |           |  |
|-----|-----------|--|
| 1.  | Januar    | Hongkong, Luxemburg, Vereinigtes Königreich, USA |
| 15. | Januar    | USA  |
| 12. | Februar   | Hongkong   |
| 13. | Februar   | Hongkong   |
| 19. | Februar   | USA  |
| 29. | März      | Hongkong, Luxemburg, Vereinigtes Königreich, USA |
| 1.  | April     | Hongkong, Luxemburg, Vereinigtes Königreich      |
| 4.  | April     | Hongkong   |
| 1.  | Mai       | Hongkong, Luxemburg                              |
| 6.  | Mai       | Vereinigtes Königreich                           |
| 9.  | Mai       | Luxemburg  |
| 15. | Mai       | Hongkong   |
| 20. | Mai       | Luxemburg  |
| 27. | Mai       | Vereinigtes Königreich, USA                      |
| 10. | Juni      | Hongkong   |
| 19. | Juni      | USA  |
| 1.  | Juli      | Hongkong   |
| 4.  | Juli      | USA  |
| 15. | August    | Luxemburg  |
| 26. | August    | Vereinigtes Königreich                           |
| 2.  | September | USA  |
| 18. | September | Hongkong   |
| 1.  | Oktober   | Hongkong   |
| 11. | Oktober   | Hongkong   |
| 14. | Oktober   | USA  |
| 1.  | November  | Luxemburg  |
| 11. | November  | USA  |
| 28. | November  | USA  |
| 25. | Dezember  | Hongkong, Luxemburg, Vereinigtes Königreich, USA |
| 26. | Dezember  | Hongkong, Luxemburg, Vereinigtes Königreich      |

# Anhang IV (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Feiertagskalender des Fonds für das Jahr 2024 (Fortsetzung)

## Global ESG Corporate Bond

(Luxemburg, USA\*\*)

|     |           |                |
|-----|-----------|----------------|
| 1.  | Januar    | Luxemburg, USA |
| 15. | Januar    | USA            |
| 19. | Februar   | USA            |
| 29. | März      | Luxemburg, USA |
| 1.  | April     | Luxemburg      |
| 1.  | Mai       | Luxemburg      |
| 9.  | Mai       | Luxemburg      |
| 20. | Mai       | Luxemburg      |
| 27. | Mai       | USA            |
| 19. | Juni      | USA            |
| 4.  | Juli      | USA            |
| 15. | August    | Luxemburg      |
| 2.  | September | USA            |
| 14. | Oktober   | USA            |
| 1.  | November  | Luxemburg      |
| 11. | November  | USA            |
| 28. | November  | USA            |
| 25. | Dezember  | Luxemburg, USA |
| 26. | Dezember  | Luxemburg      |

## Global Equity Climate Change

(Luxemburg, Vereinigtes Königreich, USA, Andere\*)

|     |           |  |
|-----|-----------|--|
| 1.  | Januar    | Luxemburg, Andere, Vereinigtes Königreich, USA |
| 15. | Januar    | USA  |
| 19. | Februar   | USA  |
| 29. | März      | Luxemburg, Andere, Vereinigtes Königreich, USA |
| 1.  | April     | Luxemburg, Andere, Vereinigtes Königreich      |
| 1.  | Mai       | Luxemburg, Andere                              |
| 6.  | Mai       | Vereinigtes Königreich                         |
| 9.  | Mai       | Luxemburg                                      |
| 20. | Mai       | Luxemburg                                      |
| 27. | Mai       | Vereinigtes Königreich, USA                    |
| 19. | Juni      | USA  |
| 4.  | Juli      | USA  |
| 15. | August    | Luxemburg                                      |
| 26. | August    | Vereinigtes Königreich                         |
| 2.  | September | USA  |
| 1.  | November  | Luxemburg                                      |
| 28. | November  | USA  |
| 25. | Dezember  | Luxemburg, Andere, Vereinigtes Königreich, USA |
| 26. | Dezember  | Luxemburg, Andere, Vereinigtes Königreich      |
| 31. | Dezember  | Andere   |

## Global Equity Circular Economy

(Frankreich, Luxemburg, USA)

|     |           |                            |
|-----|-----------|----------------------------|
| 1.  | Januar    | Frankreich, Luxemburg, USA |
| 15. | Januar    | USA                        |
| 19. | Februar   | USA                        |
| 29. | März      | Frankreich, Luxemburg, USA |
| 1.  | April     | Frankreich, Luxemburg      |
| 1.  | Mai       | Frankreich, Luxemburg      |
| 9.  | Mai       | Luxemburg                  |
| 20. | Mai       | Luxemburg                  |
| 27. | Mai       | USA                        |
| 19. | Juni      | USA                        |
| 4.  | Juli      | USA                        |
| 15. | August    | Luxemburg                  |
| 2.  | September | USA                        |
| 1.  | November  | Luxemburg                  |
| 28. | November  | USA                        |
| 25. | Dezember  | Frankreich, Luxemburg, USA |
| 26. | Dezember  | Frankreich, Luxemburg      |

## Global Equity Sustainable Healthcare

(Luxemburg, USA)

|     |           |                |
|-----|-----------|----------------|
| 1.  | Januar    | Luxemburg, USA |
| 15. | Januar    | USA            |
| 19. | Februar   | USA            |
| 29. | März      | Luxemburg, USA |
| 1.  | April     | Luxemburg      |
| 1.  | Mai       | Luxemburg      |
| 9.  | Mai       | Luxemburg      |
| 20. | Mai       | Luxemburg      |
| 27. | Mai       | USA            |
| 19. | Juni      | USA            |
| 4.  | Juli      | USA            |
| 15. | August    | Luxemburg      |
| 2.  | September | USA            |
| 1.  | November  | Luxemburg      |
| 28. | November  | USA            |
| 25. | Dezember  | Luxemburg, USA |
| 26. | Dezember  | Luxemburg      |

# Anhang IV (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Feiertagskalender des Fonds für das Jahr 2024 (Fortsetzung)

## Global Equity Volatility Focused

(Luxemburg, Vereinigtes Königreich, USA, Andere\*)

|     |           |  |
|-----|-----------|--|
| 1.  | Januar    | Luxemburg, Vereinigtes Königreich, USA |
| 15. | Januar    | USA                                    |
| 19. | Februar   | USA                                    |
| 29. | März      | Luxemburg, Vereinigtes Königreich, USA |
| 1.  | April     | Luxemburg, Vereinigtes Königreich      |
| 1.  | Mai       | Luxemburg                              |
| 6.  | Mai       | Vereinigtes Königreich                 |
| 9.  | Mai       | Luxemburg                              |
| 20. | Mai       | Luxemburg                              |
| 27. | Mai       | Vereinigtes Königreich, USA            |
| 19. | Juni      | USA                                    |
| 4.  | Juli      | USA                                    |
| 15. | August    | Luxemburg                              |
| 26. | August    | Vereinigtes Königreich                 |
| 2.  | September | USA                                    |
| 1.  | November  | Luxemburg                              |
| 28. | November  | USA                                    |
| 25. | Dezember  | Luxemburg, Vereinigtes Königreich, USA |
| 26. | Dezember  | Luxemburg, Vereinigtes Königreich      |

## Global Government Bond

(Japan, Luxemburg, Vereinigtes Königreich, USA\*\*)

|     |           |   |
|-----|-----------|---|
| 1.  | Januar    | Japan, Luxemburg, Vereinigtes Königreich, USA |
| 2.  | Januar    | Japan   |
| 3.  | Januar    | Japan   |
| 8.  | Januar    | Japan   |
| 15. | Januar    | USA   |
| 12. | Februar   | Japan   |
| 19. | Februar   | USA   |
| 23. | Februar   | Japan   |
| 20. | März      | Japan   |
| 29. | März      | Luxemburg, Vereinigtes Königreich, USA        |
| 1.  | April     | Luxemburg, Vereinigtes Königreich             |
| 29. | April     | Japan   |
| 1.  | Mai       | Luxemburg                                     |
| 3.  | Mai       | Japan   |
| 6.  | Mai       | Japan, Vereinigtes Königreich                 |
| 9.  | Mai       | Luxemburg                                     |
| 20. | Mai       | Luxemburg                                     |
| 27. | Mai       | Vereinigtes Königreich, USA                   |
| 19. | Juni      | USA   |
| 4.  | Juli      | USA   |
| 15. | Juli      | Japan   |
| 12. | August    | Japan   |
| 15. | August    | Luxemburg                                     |
| 26. | August    | Vereinigtes Königreich                        |
| 2.  | September | USA   |
| 16. | September | Japan   |
| 23. | September | Japan   |
| 14. | Oktober   | Japan, USA                                    |
| 1.  | November  | Luxemburg                                     |
| 4.  | November  | Japan   |
| 11. | November  | USA   |
| 28. | November  | USA   |
| 25. | Dezember  | Luxemburg, Vereinigtes Königreich, USA        |
| 26. | Dezember  | Luxemburg, Vereinigtes Königreich             |
| 31. | Dezember  | Japan   |

## Global Green Bond

(Frankreich, Luxemburg, USA\*\*)

|     |           |                            |
|-----|-----------|----------------------------|
| 1.  | Januar    | Frankreich, Luxemburg, USA |
| 15. | Januar    | USA                        |
| 19. | Februar   | USA                        |
| 29. | März      | Frankreich, Luxemburg, USA |
| 1.  | April     | Frankreich, Luxemburg      |
| 1.  | Mai       | Frankreich, Luxemburg      |
| 9.  | Mai       | Luxemburg                  |
| 20. | Mai       | Luxemburg                  |
| 27. | Mai       | USA                        |
| 19. | Juni      | USA                        |
| 4.  | Juli      | USA                        |
| 15. | August    | Luxemburg                  |
| 2.  | September | USA                        |
| 14. | Oktober   | USA                        |
| 1.  | November  | Luxemburg                  |
| 11. | November  | USA                        |
| 28. | November  | USA                        |
| 25. | Dezember  | Frankreich, Luxemburg, USA |
| 26. | Dezember  | Frankreich, Luxemburg      |

## Global High Income Bond, Global High Yield Bond

(Frankreich, Luxemburg, USA\*\*)

|     |           |                            |
|-----|-----------|----------------------------|
| 1.  | Januar    | Frankreich, Luxemburg, USA |
| 15. | Januar    | USA                        |
| 19. | Februar   | USA                        |
| 29. | März      | Frankreich, Luxemburg, USA |
| 1.  | April     | Frankreich, Luxemburg      |
| 1.  | Mai       | Frankreich, Luxemburg      |
| 9.  | Mai       | Luxemburg                  |
| 20. | Mai       | Luxemburg                  |
| 27. | Mai       | USA                        |
| 19. | Juni      | USA                        |
| 4.  | Juli      | USA                        |
| 15. | August    | Luxemburg                  |
| 2.  | September | USA                        |
| 14. | Oktober   | USA                        |
| 1.  | November  | Luxemburg                  |
| 11. | November  | USA                        |
| 28. | November  | USA                        |
| 25. | Dezember  | Frankreich, Luxemburg, USA |
| 26. | Dezember  | Frankreich, Luxemburg      |

# Anhang IV (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Feiertagskalender des Fonds für das Jahr 2024 (Fortsetzung)

## Global High Yield ESG Bond

(Luxemburg, USA\*\*)

|     |           |                |
|-----|-----------|----------------|
| 1.  | Januar    | Luxemburg, USA |
| 15. | Januar    | USA            |
| 19. | Februar   | USA            |
| 29. | März      | Luxemburg, USA |
| 1.  | April     | Luxemburg      |
| 1.  | Mai       | Luxemburg      |
| 9.  | Mai       | Luxemburg      |
| 20. | Mai       | Luxemburg      |
| 27. | Mai       | Luxemburg, USA |
| 19. | Juni      | USA            |
| 4.  | Juli      | USA            |
| 15. | August    | Luxemburg      |
| 2.  | September | USA            |
| 14. | Oktober   | USA            |
| 1.  | November  | Luxemburg      |
| 11. | November  | USA            |
| 28. | November  | USA            |
| 25. | Dezember  | Luxemburg, USA |
| 26. | Dezember  | Luxemburg      |

## Global Inflation Linked Bond

(Luxemburg, Vereinigtes Königreich, USA\*\*)

|     |           |  |
|-----|-----------|--|
| 1.  | Januar    | Luxemburg, Vereinigtes Königreich, USA |
| 15. | Januar    | USA                                    |
| 19. | Februar   | USA                                    |
| 29. | März      | Luxemburg, Vereinigtes Königreich, USA |
| 1.  | April     | Luxemburg, Vereinigtes Königreich      |
| 1.  | Mai       | Luxemburg                              |
| 6.  | Mai       | Vereinigtes Königreich                 |
| 9.  | Mai       | Luxemburg                              |
| 20. | Mai       | Luxemburg                              |
| 27. | Mai       | Vereinigtes Königreich, USA            |
| 19. | Juni      | USA                                    |
| 4.  | Juli      | USA                                    |
| 15. | August    | Luxemburg                              |
| 26. | August    | Vereinigtes Königreich                 |
| 2.  | September | USA                                    |
| 14. | Oktober   | USA                                    |
| 1.  | November  | Luxemburg                              |
| 11. | November  | USA                                    |
| 28. | November  | USA                                    |
| 25. | Dezember  | Luxemburg, Vereinigtes Königreich, USA |
| 26. | Dezember  | Luxemburg, Vereinigtes Königreich      |

## Global Infrastructure Equity

(Kanada, Luxemburg, USA\*\*)

|     |           |                        |
|-----|-----------|------------------------|
| 1.  | Januar    | Kanada, Luxemburg, USA |
| 15. | Januar    | USA                    |
| 19. | Februar   | Kanada, USA            |
| 29. | März      | Kanada, Luxemburg, USA |
| 1.  | April     | Luxemburg              |
| 1.  | Mai       | Luxemburg              |
| 9.  | Mai       | Luxemburg              |
| 20. | Mai       | Kanada, Luxemburg      |
| 27. | Mai       | USA                    |
| 19. | Juni      | USA                    |
| 1.  | Juli      | Kanada                 |
| 4.  | Juli      | USA                    |
| 5.  | August    | Kanada                 |
| 15. | August    | Luxemburg              |
| 2.  | September | Kanada, USA            |
| 14. | Oktober   | Kanada                 |
| 1.  | November  | Luxemburg              |
| 28. | November  | USA                    |
| 25. | Dezember  | Kanada, Luxemburg, USA |
| 26. | Dezember  | Kanada, Luxemburg      |

## Global Lower Carbon Bond

(Frankreich, Luxemburg, USA\*\*)

|     |           |                            |
|-----|-----------|----------------------------|
| 1.  | Januar    | Frankreich, Luxemburg, USA |
| 15. | Januar    | USA                        |
| 19. | Februar   | USA                        |
| 29. | März      | Frankreich, Luxemburg, USA |
| 1.  | April     | Frankreich, Luxemburg      |
| 1.  | Mai       | Frankreich, Luxemburg      |
| 9.  | Mai       | Luxemburg                  |
| 20. | Mai       | Luxemburg                  |
| 27. | Mai       | USA                        |
| 19. | Juni      | USA                        |
| 4.  | Juli      | USA                        |
| 15. | August    | Luxemburg                  |
| 2.  | September | USA                        |
| 14. | Oktober   | USA                        |
| 1.  | November  | Luxemburg                  |
| 11. | November  | USA                        |
| 28. | November  | USA                        |
| 25. | Dezember  | Frankreich, Luxemburg, USA |
| 26. | Dezember  | Frankreich, Luxemburg      |

# Anhang IV (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Feiertagskalender des Fonds für das Jahr 2024 (Fortsetzung)

## Global Lower Carbon Equity

(Luxemburg, Vereinigtes Königreich, USA)

|     |           |  |
|-----|-----------|--|
| 1.  | Januar    | Luxemburg, Vereinigtes Königreich, USA |
| 15. | Januar    | USA                                    |
| 19. | Februar   | USA                                    |
| 29. | März      | Luxemburg, Vereinigtes Königreich, USA |
| 1.  | April     | Luxemburg, Vereinigtes Königreich      |
| 1.  | Mai       | Luxemburg                              |
| 6.  | Mai       | Vereinigtes Königreich                 |
| 9.  | Mai       | Luxemburg                              |
| 20. | Mai       | Luxemburg                              |
| 27. | Mai       | Vereinigtes Königreich, USA            |
| 19. | Juni      | USA                                    |
| 4.  | Juli      | USA                                    |
| 15. | August    | Luxemburg                              |
| 26. | August    | Vereinigtes Königreich                 |
| 2.  | September | USA                                    |
| 1.  | November  | Luxemburg                              |
| 28. | November  | USA                                    |
| 25. | Dezember  | Luxemburg, Vereinigtes Königreich, USA |
| 26. | Dezember  | Luxemburg, Vereinigtes Königreich      |

## Global Real Estate Equity

(Luxemburg, Vereinigtes Königreich, USA)

|     |           |  |
|-----|-----------|--|
| 1.  | Januar    | Luxemburg, Vereinigtes Königreich, USA |
| 15. | Januar    | USA                                    |
| 19. | Februar   | USA                                    |
| 29. | März      | Luxemburg, Vereinigtes Königreich, USA |
| 1.  | April     | Luxemburg, Vereinigtes Königreich      |
| 1.  | Mai       | Luxemburg                              |
| 6.  | Mai       | Vereinigtes Königreich                 |
| 9.  | Mai       | Luxemburg                              |
| 20. | Mai       | Luxemburg                              |
| 27. | Mai       | Vereinigtes Königreich, USA            |
| 19. | Juni      | USA                                    |
| 4.  | Juli      | USA                                    |
| 15. | August    | Luxemburg                              |
| 26. | August    | Vereinigtes Königreich                 |
| 2.  | September | USA                                    |
| 1.  | November  | Luxemburg                              |
| 28. | November  | USA                                    |
| 25. | Dezember  | Luxemburg, Vereinigtes Königreich, USA |
| 26. | Dezember  | Luxemburg, Vereinigtes Königreich      |

## Global Short Duration Bond

(Luxemburg, Vereinigtes Königreich, USA\*\*)

|     |           |  |
|-----|-----------|--|
| 1.  | Januar    | Luxemburg, Vereinigtes Königreich, USA |
| 15. | Januar    | USA                                    |
| 19. | Februar   | USA                                    |
| 29. | März      | Luxemburg, Vereinigtes Königreich, USA |
| 1.  | April     | Luxemburg, Vereinigtes Königreich      |
| 1.  | Mai       | Luxemburg                              |
| 6.  | Mai       | Vereinigtes Königreich                 |
| 9.  | Mai       | Luxemburg                              |
| 20. | Mai       | Luxemburg                              |
| 27. | Mai       | Luxemburg, Vereinigtes Königreich, USA |
| 19. | Juni      | USA                                    |
| 4.  | Juli      | USA                                    |
| 15. | August    | Luxemburg                              |
| 26. | August    | Vereinigtes Königreich                 |
| 2.  | September | USA                                    |
| 14. | Oktober   | USA                                    |
| 1.  | November  | Luxemburg                              |
| 11. | November  | USA                                    |
| 28. | November  | USA                                    |
| 25. | Dezember  | Luxemburg, Vereinigtes Königreich, USA |
| 26. | Dezember  | Luxemburg, Vereinigtes Königreich      |

## Global Sustainable Equity Income

(Luxemburg, USA)

|     |           |                |
|-----|-----------|----------------|
| 1.  | Januar    | Luxemburg, USA |
| 15. | Januar    | USA            |
| 19. | Februar   | USA            |
| 29. | März      | Luxemburg, USA |
| 1.  | April     | Luxemburg      |
| 1.  | Mai       | Luxemburg      |
| 9.  | Mai       | Luxemburg      |
| 20. | Mai       | Luxemburg      |
| 27. | Mai       | Luxemburg, USA |
| 19. | Juni      | USA            |
| 4.  | Juli      | USA            |
| 15. | August    | Luxemburg      |
| 2.  | September | USA            |
| 1.  | November  | Luxemburg      |
| 28. | November  | USA            |
| 25. | Dezember  | Luxemburg, USA |
| 26. | Dezember  | Luxemburg      |

# Anhang IV (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Feiertagskalender des Fonds für das Jahr 2024 (Fortsetzung)

## Global Sustainable Long Term Dividend

(Luxemburg, Vereinigtes Königreich, USA, Andere\*)

|     |           |  |
|-----|-----------|--|
| 1.  | Januar    | Luxemburg, Andere, Vereinigtes Königreich, USA |
| 15. | Januar    | USA  |
| 19. | Februar   | USA  |
| 29. | März      | Luxemburg, Andere, Vereinigtes Königreich, USA |
| 1.  | April     | Luxemburg, Andere, Vereinigtes Königreich      |
| 1.  | Mai       | Luxemburg, Andere                              |
| 6.  | Mai       | Vereinigtes Königreich                         |
| 9.  | Mai       | Luxemburg                                      |
| 20. | Mai       | Luxemburg                                      |
| 27. | Mai       | Vereinigtes Königreich, USA                    |
| 19. | Juni      | USA  |
| 4.  | Juli      | USA  |
| 15. | August    | Luxemburg                                      |
| 26. | August    | Vereinigtes Königreich                         |
| 2.  | September | USA  |
| 1.  | November  | Luxemburg                                      |
| 28. | November  | USA  |
| 24. | Dezember  | Andere   |
| 25. | Dezember  | Luxemburg, Andere, Vereinigtes Königreich, USA |
| 26. | Dezember  | Luxemburg, Andere, Vereinigtes Königreich      |
| 31. | Dezember  | Andere   |

## Global Sustainable Long Term Equity

(Luxemburg, Vereinigtes Königreich, USA)

|     |           |  |
|-----|-----------|--|
| 1.  | Januar    | Luxemburg, Vereinigtes Königreich, USA |
| 15. | Januar    | USA                                    |
| 19. | Februar   | USA                                    |
| 29. | März      | Luxemburg, Vereinigtes Königreich, USA |
| 1.  | April     | Luxemburg, Vereinigtes Königreich      |
| 1.  | Mai       | Luxemburg                              |
| 6.  | Mai       | Vereinigtes Königreich                 |
| 9.  | Mai       | Luxemburg                              |
| 20. | Mai       | Luxemburg                              |
| 27. | Mai       | Luxemburg, Vereinigtes Königreich, USA |
| 19. | Juni      | USA                                    |
| 4.  | Juli      | USA                                    |
| 15. | August    | Luxemburg                              |
| 26. | August    | Vereinigtes Königreich                 |
| 2.  | September | USA                                    |
| 14. | Oktober   | USA                                    |
| 1.  | November  | Luxemburg                              |
| 11. | November  | USA                                    |
| 28. | November  | USA                                    |
| 25. | Dezember  | Luxemburg, Vereinigtes Königreich, USA |
| 26. | Dezember  | Luxemburg, Vereinigtes Königreich      |

## Hong Kong Equity

(Hongkong, Luxemburg)

|     |           |                     |
|-----|-----------|---------------------|
| 1.  | Januar    | Hongkong, Luxemburg |
| 12. | Februar   | Hongkong            |
| 13. | Februar   | Hongkong            |
| 29. | März      | Hongkong, Luxemburg |
| 1.  | April     | Hongkong, Luxemburg |
| 4.  | April     | Hongkong            |
| 1.  | Mai       | Hongkong, Luxemburg |
| 9.  | Mai       | Luxemburg           |
| 15. | Mai       | Hongkong            |
| 20. | Mai       | Luxemburg           |
| 10. | Juni      | Hongkong            |
| 1.  | Juli      | Hongkong            |
| 15. | August    | Luxemburg           |
| 18. | September | Hongkong            |
| 1.  | Oktober   | Hongkong            |
| 11. | Oktober   | Hongkong            |
| 1.  | November  | Luxemburg           |
| 25. | Dezember  | Hongkong, Luxemburg |
| 26. | Dezember  | Hongkong, Luxemburg |

## India Fixed Income

(Hongkong, Indien, Luxemburg)

|     |           |                             |
|-----|-----------|-----------------------------|
| 1.  | Januar    | Hongkong, Luxemburg         |
| 26. | Januar    | Indien                      |
| 12. | Februar   | Hongkong                    |
| 13. | Februar   | Hongkong                    |
| 19. | Februar   | Indien                      |
| 8.  | März      | Indien                      |
| 25. | März      | Indien                      |
| 29. | März      | Hongkong, Indien, Luxemburg |
| 1.  | April     | Hongkong, Indien, Luxemburg |
| 4.  | April     | Hongkong                    |
| 9.  | April     | Indien, Luxemburg           |
| 11. | April     | Indien                      |
| 17. | April     | Indien                      |
| 1.  | Mai       | Hongkong, Indien, Luxemburg |
| 9.  | Mai       | Luxemburg                   |
| 15. | Mai       | Hongkong                    |
| 20. | Mai       | Indien, Luxemburg           |
| 23. | Mai       | Indien                      |
| 10. | Juni      | Hongkong                    |
| 17. | Juni      | Indien                      |
| 1.  | Juli      | Hongkong                    |
| 17. | Juli      | Indien                      |
| 15. | August    | Indien, Luxemburg           |
| 16. | September | Indien                      |
| 18. | September | Hongkong                    |
| 1.  | Oktober   | Hongkong                    |
| 2.  | Oktober   | Indien                      |
| 11. | Oktober   | Hongkong                    |
| 1.  | November  | Indien, Luxemburg           |
| 15. | November  | Indien                      |
| 25. | Dezember  | Hongkong, Indien, Luxemburg |
| 26. | Dezember  | Hongkong, Luxemburg         |

# Anhang IV (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Feiertagskalender des Fonds für das Jahr 2024 (Fortsetzung)

## Indian Equity

(Indien, Luxemburg)

|     |          |                   |
|-----|----------|-------------------|
| 1.  | Januar   | Luxemburg         |
| 26. | Januar   | Indien            |
| 8.  | März     | Indien            |
| 25. | März     | Indien            |
| 29. | März     | Indien, Luxemburg |
| 1.  | April    | Luxemburg         |
| 11. | April    | Indien            |
| 17. | April    | Indien            |
| 1.  | Mai      | Indien, Luxemburg |
| 9.  | Mai      | Luxemburg         |
| 20. | Mai      | Indien, Luxemburg |
| 17. | Juni     | Indien            |
| 17. | Juli     | Indien            |
| 15. | August   | Indien, Luxemburg |
| 2.  | Oktober  | Indien            |
| 1.  | November | Indien, Luxemburg |
| 15. | November | Indien            |
| 25. | Dezember | Indien, Luxemburg |
| 26. | Dezember | Luxemburg         |

## Managed Solutions – Asia Focused Conservative, Managed Solutions -

Asia Focused Growth, Managed Solutions – Asia Focused Income

(Hongkong, Luxemburg)

|     |           |                     |
|-----|-----------|---------------------|
| 1.  | Januar    | Hongkong, Luxemburg |
| 12. | Februar   | Hongkong            |
| 13. | Februar   | Hongkong            |
| 29. | März      | Hongkong, Luxemburg |
| 1.  | April     | Hongkong, Luxemburg |
| 4.  | April     | Hongkong            |
| 1.  | Mai       | Hongkong, Luxemburg |
| 9.  | Mai       | Luxemburg           |
| 15. | Mai       | Hongkong            |
| 20. | Mai       | Luxemburg           |
| 10. | Juni      | Hongkong            |
| 1.  | Juli      | Hongkong            |
| 15. | August    | Luxemburg           |
| 18. | September | Hongkong            |
| 1.  | Oktober   | Hongkong            |
| 11. | Oktober   | Hongkong            |
| 1.  | November  | Luxemburg           |
| 25. | Dezember  | Hongkong, Luxemburg |
| 26. | Dezember  | Hongkong, Luxemburg |

## Multi-Asset Style Factors, Multi-Strategy Target Return

(CBOT, CME, Eurex, Frankreich (gesetzliche Feiertage), Luxemburg, USA)

|     |           |  |
|-----|-----------|--|
| 1.  | Januar    | CBOT, CME, Eurex, Frankreich, Luxemburg, USA |
| 15. | Januar    | CBOT, CME, USA                               |
| 19. | Februar   | CBOT, CME, USA                               |
| 29. | März      | CBOT, Eurex, Luxemburg, USA                  |
| 1.  | April     | Eurex, Frankreich, Luxemburg                 |
| 1.  | Mai       | Eurex, Frankreich, Luxemburg                 |
| 8.  | Mai       | Frankreich                                   |
| 9.  | Mai       | Frankreich, Luxemburg                        |
| 20. | Mai       | Frankreich, Luxemburg                        |
| 27. | Mai       | CBOT, CME, USA                               |
| 19. | Juni      | CBOT, CME, USA                               |
| 4.  | Juli      | CBOT, CME, USA                               |
| 15. | August    | Frankreich, Luxemburg                        |
| 2.  | September | CBOT, CME, USA                               |
| 1.  | November  | Frankreich, Luxemburg                        |
| 11. | November  | Frankreich                                   |
| 28. | November  | CBOT, CME, USA                               |
| 24. | Dezember  | Eurex  |
| 25. | Dezember  | CBOT, CME, Eurex, Frankreich, Luxemburg, USA |
| 26. | Dezember  | Eurex, Luxemburg                             |
| 31. | Dezember  | Eurex  |

# Anhang IV (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Feiertagskalender des Fonds für das Jahr 2024 (Fortsetzung)

## **RMB Fixed Income**

(China, Hongkong, Luxemburg, Vereinigtes Königreich, USA\*\*)

|     |           |   |
|-----|-----------|---|
| 1.  | Januar    | China, Hongkong, Luxemburg, Vereinigtes Königreich, USA |
| 15. | Januar    | USA   |
| 9.  | Februar   | China   |
| 12. | Februar   | China, Hongkong   |
| 13. | Februar   | China, Hongkong   |
| 14. | Februar   | China   |
| 15. | Februar   | China   |
| 16. | Februar   | China   |
| 19. | Februar   | USA   |
| 29. | März      | Hongkong, Luxemburg, Vereinigtes Königreich, USA        |
| 1.  | April     | Hongkong, Luxemburg, Vereinigtes Königreich             |
| 4.  | April     | China, Hongkong   |
| 5.  | April     | China   |
| 1.  | Mai       | China, Hongkong, Luxemburg                              |
| 2.  | Mai       | China   |
| 3.  | Mai       | China   |
| 6.  | Mai       | Vereinigtes Königreich                                  |
| 9.  | Mai       | Luxemburg   |
| 15. | Mai       | Hongkong  |
| 20. | Mai       | Luxemburg   |
| 27. | Mai       | Vereinigtes Königreich, USA                             |
| 10. | Juni      | China, Hongkong   |
| 19. | Juni      | USA   |
| 1.  | Juli      | Hongkong  |
| 4.  | Juli      | USA   |
| 15. | August    | Luxemburg   |
| 26. | August    | Vereinigtes Königreich                                  |
| 2.  | September | USA   |
| 16. | September | China   |
| 17. | September | China   |
| 18. | September | Hongkong  |
| 1.  | Oktober   | China, Hongkong   |
| 2.  | Oktober   | China   |
| 3.  | Oktober   | China   |
| 4.  | Oktober   | China   |
| 7.  | Oktober   | China   |
| 11. | Oktober   | Hongkong  |
| 14. | Oktober   | USA   |
| 1.  | November  | Luxemburg   |
| 11. | November  | USA   |
| 28. | November  | USA   |
| 25. | Dezember  | Hongkong, Luxemburg, Vereinigtes Königreich, USA        |
| 26. | Dezember  | Hongkong, Luxemburg, Vereinigtes Königreich             |

## **Russia Equity\*\*\*\***

(Luxemburg, Russland, Vereinigtes Königreich)

|     |          |   |
|-----|----------|---|
| 1.  | Januar   | Luxemburg, Russland, Vereinigtes Königreich |
| 2.  | Januar   | Russland                                    |
| 23. | Februar  | Russland                                    |
| 8.  | März     | Russland                                    |
| 29. | März     | Luxemburg, Vereinigtes Königreich           |
| 1.  | April    | Luxemburg, Vereinigtes Königreich           |
| 1.  | Mai      | Luxemburg, Russland                         |
| 6.  | Mai      | Vereinigtes Königreich                      |
| 9.  | Mai      | Luxemburg, Russland                         |
| 20. | Mai      | Luxemburg                                   |
| 27. | Mai      | Vereinigtes Königreich                      |
| 12. | Juni     | Russland                                    |
| 15. | August   | Luxemburg                                   |
| 26. | August   | Vereinigtes Königreich                      |
| 1.  | November | Luxemburg                                   |
| 4.  | November | Russland                                    |
| 25. | Dezember | Luxemburg, Vereinigtes Königreich           |
| 26. | Dezember | Luxemburg, Vereinigtes Königreich           |

## **Singapore Dollar Income Bond**

(Hongkong, Luxemburg, Singapur)

|     |           |                               |
|-----|-----------|-------------------------------|
| 1.  | Januar    | Hongkong, Luxemburg, Singapur |
| 12. | Februar   | Hongkong, Singapur            |
| 13. | Februar   | Hongkong                      |
| 29. | März      | Hongkong, Luxemburg, Singapur |
| 1.  | April     | Hongkong, Luxemburg           |
| 4.  | April     | Hongkong                      |
| 10. | April     | Singapur                      |
| 1.  | Mai       | Hongkong, Luxemburg, Singapur |
| 9.  | Mai       | Luxemburg                     |
| 15. | Mai       | Hongkong                      |
| 20. | Mai       | Luxemburg                     |
| 22. | Mai       | Singapur                      |
| 10. | Juni      | Hongkong                      |
| 17. | Juni      | Singapur                      |
| 1.  | Juli      | Hongkong                      |
| 9.  | August    | Singapur                      |
| 15. | August    | Luxemburg                     |
| 18. | September | Hongkong                      |
| 1.  | Oktober   | Hongkong                      |
| 11. | Oktober   | Hongkong                      |
| 31. | Oktober   | Singapur                      |
| 1.  | November  | Luxemburg                     |
| 25. | Dezember  | Hongkong, Luxemburg, Singapur |
| 26. | Dezember  | Hongkong, Luxemburg           |



# Anhang IV (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Feiertagskalender des Fonds für das Jahr 2024 (Fortsetzung)

## **Turkey Equity**

(Luxemburg, Türkei)

|     |          |                   |
|-----|----------|-------------------|
| 1.  | Januar   | Luxemburg, Türkei |
| 29. | März     | Luxemburg         |
| 1.  | April    | Luxemburg         |
| 9.  | April    | Türkei            |
| 10. | April    | Türkei            |
| 11. | April    | Türkei            |
| 12. | April    | Türkei            |
| 23. | April    | Türkei            |
| 1.  | Mai      | Luxemburg, Türkei |
| 9.  | Mai      | Luxemburg         |
| 20. | Mai      | Luxemburg         |
| 17. | Juni     | Türkei            |
| 18. | Juni     | Türkei            |
| 19. | Juni     | Türkei            |
| 15. | August   | Luxemburg         |
| 30. | August   | Türkei            |
| 28. | Oktober  | Türkei            |
| 29. | Oktober  | Türkei            |
| 1.  | November | Luxemburg         |
| 25. | Dezember | Luxemburg         |
| 26. | Dezember | Luxemburg         |

## **Ultra Short Duration Bond**

(Luxemburg, USA\*\*)

|     |           |                |
|-----|-----------|----------------|
| 1.  | Januar    | Luxemburg, USA |
| 15. | Januar    | USA            |
| 19. | Februar   | USA            |
| 29. | März      | Luxemburg, USA |
| 1.  | April     | Luxemburg      |
| 1.  | Mai       | Luxemburg      |
| 9.  | Mai       | Luxemburg      |
| 20. | Mai       | Luxemburg      |
| 27. | Mai       | Luxemburg, USA |
| 19. | Juni      | USA            |
| 4.  | Juli      | USA            |
| 15. | August    | Luxemburg      |
| 2.  | September | USA            |
| 14. | Oktober   | USA            |
| 1.  | November  | Luxemburg      |
| 11. | November  | USA            |
| 28. | November  | USA            |
| 25. | Dezember  | Luxemburg, USA |
| 26. | Dezember  | Luxemburg      |

## **US Dollar Bond, US High Yield Bond**

(Luxemburg, USA\*\*)

|     |           |                |
|-----|-----------|----------------|
| 1.  | Januar    | Luxemburg, USA |
| 15. | Januar    | USA            |
| 19. | Februar   | USA            |
| 29. | März      | Luxemburg, USA |
| 1.  | April     | Luxemburg      |
| 1.  | Mai       | Luxemburg      |
| 9.  | Mai       | Luxemburg      |
| 20. | Mai       | Luxemburg      |
| 27. | Mai       | Luxemburg, USA |
| 19. | Juni      | USA            |
| 4.  | Juli      | USA            |
| 15. | August    | Luxemburg      |
| 2.  | September | USA            |
| 14. | Oktober   | USA            |
| 1.  | November  | Luxemburg      |
| 11. | November  | USA            |
| 28. | November  | USA            |
| 25. | Dezember  | Luxemburg, USA |
| 26. | Dezember  | Luxemburg      |

# Anhang IV (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Feiertagskalender des Fonds für das Jahr 2024 (Fortsetzung)

## US Income Focused

(Luxemburg, Vereinigtes Königreich, USA, USA\*\*)

|     |           |  |
|-----|-----------|--|
| 1.  | Januar    | Luxemburg, Vereinigtes Königreich, USA |
| 15. | Januar    | USA                                    |
| 19. | Februar   | USA                                    |
| 29. | März      | Luxemburg, Vereinigtes Königreich, USA |
| 1.  | April     | Luxemburg, Vereinigtes Königreich      |
| 1.  | Mai       | Luxemburg                              |
| 6.  | Mai       | Vereinigtes Königreich                 |
| 9.  | Mai       | Luxemburg                              |
| 20. | Mai       | Luxemburg                              |
| 27. | Mai       | Vereinigtes Königreich, USA            |
| 19. | Juni      | USA                                    |
| 4.  | Juli      | USA                                    |
| 15. | August    | Luxemburg                              |
| 26. | August    | Vereinigtes Königreich                 |
| 2.  | September | USA                                    |
| 14. | Oktober   | USA                                    |
| 1.  | November  | Luxemburg                              |
| 11. | November  | USA                                    |
| 28. | November  | USA                                    |
| 25. | Dezember  | Luxemburg, Vereinigtes Königreich, USA |
| 26. | Dezember  | Luxemburg, Vereinigtes Königreich      |

---

## US Short Duration High Yield Bond<sup>2</sup>

(Frankreich, Luxemburg, USA\*\*)

|     |           |                            |
|-----|-----------|----------------------------|
| 1.  | Januar    | Frankreich, Luxemburg, USA |
| 15. | Januar    | USA                        |
| 19. | Februar   | USA                        |
| 29. | März      | Frankreich, Luxemburg, USA |
| 1.  | April     | Frankreich, Luxemburg      |
| 1.  | Mai       | Frankreich, Luxemburg      |
| 9.  | Mai       | Luxemburg                  |
| 20. | Mai       | Luxemburg                  |
| 27. | Mai       | USA                        |
| 19. | Juni      | USA                        |
| 4.  | Juli      | USA                        |
| 15. | August    | Luxemburg                  |
| 2.  | September | USA                        |
| 14. | Oktober   | USA                        |
| 1.  | November  | Luxemburg                  |
| 11. | November  | USA                        |
| 28. | November  | USA                        |
| 25. | Dezember  | Frankreich, Luxemburg, USA |
| 26. | Dezember  | Frankreich, Luxemburg      |

<sup>2</sup> Bis zum 2. Juli 2023 lautete der Name des Teilfonds „Global Short Duration High Yield Bond“.

---

\* Andere – Tage, an denen andere einzelne Märkte, die zusammengenommen einen wesentlichen Teil des zugrunde liegenden Engagements des Fonds ausmachen, geschlossen sind.

\*\* Die NYSE und Nasdaq sind am Columbus Day (14. Oktober) und am Veterans Day (11. November) geöffnet. Somit gilt für Aktiefonds, die die USA als einen Hauptmarkt aufgeführt haben, an diesen Tagen kein Feiertag. Die Anleihenmärkte werden an diesen Tagen für den Handel geschlossen und Rententeilfonds, die die USA als Hauptmarkt aufgeführt haben, sind an diesen Tagen nicht handelbar.

\*\*\* Der NIW wird wöchentlich am Montag (oder am unmittelbar darauf folgenden Geschäftstag, falls der Montag kein Geschäftstag ist) berechnet.

\*\*\*\* Der Handel und die Berechnung des Nettoinventarwerts des Teilfonds Russia Equity sind seit 25. Februar 2022 aufgrund der Schließung der Moskauer Börse ausgesetzt.

# Anhang V (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Anlageberater

Der Verwaltungsrat von HSBC Global Investment Funds ist für die allgemeine Anlagepolitik, die Ziele und die Verwaltung von HSBC Global Investment Funds und ihren Teilfonds verantwortlich.

Der Verwaltungsrat hat HSBC Investment Funds (Luxembourg) S.A. zur Verwaltungsgesellschaft bestellt, die unter der Aufsicht des Verwaltungsrates für die tägliche Anlageverwaltung für alle Teilfonds zuständig ist.

Die Verwaltungsgesellschaft hat die Anlageverwaltungsdienstleistungen an Anlageberater übertragen.

In der nachfolgenden Tabelle sind der Anlageberater und, wo zutreffend, auch der bzw. die Unteranlageberater jedes Teilfonds aufgeführt.

| Teilfonds                                  | Anlageberater                                    | Unteranlageberater                        |
|--|--|---|
| <b>Aktienteilfonds</b>                     |  |   |
| Asia ex Japan Equity                       | HSBC Global Asset Management (Hong Kong) Limited |   |
| Asia ex Japan Equity Smaller Companies     | HSBC Global Asset Management (Hong Kong) Limited | HSBC Asset Management (India) Pvt Limited |
| Asia Pacific ex Japan Equity High Dividend | HSBC Global Asset Management (Hong Kong) Limited |   |
| China A-Shares Equity                      | HSBC Global Asset Management (Hong Kong) Limited |   |
| Chinese Equity                             | HSBC Global Asset Management (Hong Kong) Limited |   |
| Euroland Equity Smaller Companies          | HSBC Asset Management (France)                   |   |
| Euroland Growth                            | HSBC Asset Management (France)                   |   |
| Euroland Value                             | HSBC Asset Management (France)                   |   |
| Europe Value                               | HSBC Asset Management (France)                   |   |
| Global Emerging Markets Equity             | HSBC Asset Management (UK) Limited               |   |
| Global Equity Circular Economy             | HSBC Asset Management (France)                   |   |
| Global Equity Climate Change               | HSBC Asset Management (France)                   |   |
| Global Sustainable Equity Income           | HSBC Asset Management (France)                   |   |
| Global Equity Sustainable Healthcare       | HSBC Asset Management (France)                   |   |
| Global Infrastructure Equity               | HSBC Asset Management (France)                   |   |
| Global Lower Carbon Equity                 | HSBC Asset Management (UK) Limited               |   |
| Global Sustainable Long Term Equity        | HSBC Asset Management (UK) Limited               |   |
| Global Sustainable Long Term Dividend      | HSBC Asset Management (UK) Limited               |   |
| Hong Kong Equity                           | HSBC Global Asset Management (Hong Kong) Limited |   |

# Anhang V (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Anlageberater (Fortsetzung)

| Teilfonds   | Anlageberater                                    | Unteranlageberater |
|---|--|--------------------|
| <b>Internationale und regionale Aktienteilfonds</b>                   |  |                    |
| BRIC Equity   | HSBC Asset Management (UK) Limited               |                    |
| BRIC Markets Equity   | HSBC Asset Management (UK) Limited               |                    |
| Frontier Markets  | HSBC Asset Management (UK) Limited               |                    |
| Global Equity Volatility Focused                                      | HSBC Asset Management (UK) Limited               |                    |
| Global Real Estate Equity   | HSBC Asset Management (UK) Limited               |                    |
| <b>Marktspezifische Aktienteilfonds</b>                               |  |                    |
| ASEAN Equity <sup>1</sup>   | HSBC Global Asset Management (Hong Kong) Limited |                    |
| Brazil Equity   | HSBC Asset Management (UK) Limited               |                    |
| Economic Scale US Equity  | HSBC Asset Management (UK) Limited               |                    |
| Indian Equity   | HSBC Global Asset Management (Hong Kong) Limited |                    |
| Russia Equity*  | HSBC Asset Management (UK) Limited               |                    |
| Turkey Equity   | HSBC Portfoy Yonetimi A.S.                       |                    |
| <b>Rententeilfonds</b>  |  |                    |
| Asia Bond   | HSBC Global Asset Management (Hong Kong) Limited |                    |
| Asia ESG Bond   | HSBC Global Asset Management (Hong Kong) Limited |                    |
| Asia High Yield Bond  | HSBC Global Asset Management (Hong Kong) Limited |                    |
| Asian Currencies Bond   | HSBC Global Asset Management (Hong Kong) Limited |                    |
| Brazil Bond   | HSBC Asset Management (USA) Inc.                 |                    |
| Corporate Euro Bond Fixed Term Bond 2027 (aufgelegt am 30. Juni 2023) | HSBC Asset Management (France)                   |                    |
| Euro Bond   | HSBC Asset Management (France)                   |                    |
| Euro Credit Bond  | HSBC Asset Management (France)                   |                    |
| Euro Bond Total Return  | HSBC Asset Management (France)                   |                    |
| Euro High Yield Bond  | HSBC Asset Management (France)                   |                    |
| ESG Short Duration Credit Bond  | HSBC Asset Management (USA) Inc.                 |                    |

\* Der Handel und die Berechnung des Nettoinventarwerts des Teilfonds Russia Equity sind seit 25. Februar 2022 aufgrund der Schließung der Moskauer Börse ausgesetzt.

<sup>1</sup> Bis zum 1. August 2023 lautete der Name des Teilfonds „Thai Equity“.

# Anhang V (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Anlageberater (Fortsetzung)

| Teilfonds  | Anlageberater                      | Unteranlageberater   |
|--|------------------------------------|--|
| GEM Debt Total Return                              | HSBC Asset Management (USA) Inc.   |  |
| Global Bond  | HSBC Asset Management (UK) Limited |  |
| Global Bond Total Return                           | HSBC Asset Management (UK) Limited |  |
| Global Corporate Bond                              | HSBC Asset Management (USA) Inc.   | HSBC Asset Management (France) und HSBC Asset Management (UK) Limited, um für einen Teil des Teilfondsportfolios Anlageverwaltungsdienste mit Dispositionsbefugnis zur Verfügung zu stellen. |
| Global Emerging Markets Bond                       | HSBC Asset Management (USA) Inc.   |  |
| Global Emerging Markets ESG Bond                   | HSBC Asset Management (USA) Inc.   |  |
| Global Emerging Markets ESG Local Debt             | HSBC Asset Management (USA) Inc.   |  |
| Global Emerging Markets Local Debt                 | HSBC Asset Management (USA) Inc.   |  |
| Global Emerging Markets Corporate Sustainable Bond | HSBC Asset Management (UK) Limited |  |
| Global ESG Corporate Bond                          | HSBC Asset Management (USA) Inc.   |  |
| Global Government Bond                             | HSBC Asset Management (UK) Limited |  |
| Global Green Bond                                  | HSBC Asset Management (France)     |  |
| Global High Income Bond                            | HSBC Asset Management (USA) Inc.   | HSBC Asset Management (France) und HSBC Asset Management (UK) Limited, um für einen Teil des Teilfondsportfolios Anlageverwaltungsdienste mit Dispositionsbefugnis zur Verfügung zu stellen. |
| Global High Yield Bond                             | HSBC Asset Management (USA) Inc.   | HSBC Asset Management (France), um für einen Teil des Teilfondsportfolios Anlageverwaltungsdienste mit Dispositionsbefugnis zur Verfügung zu stellen.  |
| Global High Yield ESG Bond                         | HSBC Asset Management (USA) Inc.   |  |
| Global High Yield Securitised Credit Bond          | HSBC Asset Management (UK) Limited |  |
| Global Inflation Linked Bond                       | HSBC Asset Management (UK) Limited |  |
| Global Investment Grade Securitised Credit Bond    | HSBC Asset Management (UK) Limited |  |

# Anhang V (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Anlageberater (Fortsetzung)

| Teilfonds                                      | Anlageberater                                    | Unteranlageberater  |
|--|--|---|
| Global Lower Carbon Bond                       | HSBC Asset Management (USA) Inc.                 | HSBC Asset Management (France), um für einen Teil des Teilfondsportfolios Anlageverwaltungsdienste mit Dispositionsbefugnis zur Verfügung zu stellen.                           |
| Global Securitised Credit Bond                 | HSBC Asset Management (UK) Limited               |   |
| Global Short Duration Bond                     | HSBC Asset Management (UK) Limited               |   |
| India Fixed Income                             | HSBC Global Asset Management (Hong Kong) Limited | HSBC Global Asset Management (Hong Kong) Limited hat HSBC Asset Management (India) Pvt Limited für die Erbringung von Anlageberatungsdiensten bezüglich des Teilfonds bestellt. |
| RMB Fixed Income                               | HSBC Global Asset Management (Hong Kong) Limited |   |
| Singapore Dollar Income Bond                   | HSBC Global Asset Management (Hong Kong) Limited |   |
| Ultra Short Duration Bond                      | HSBC Asset Management (USA) Inc.                 |   |
| US Dollar Bond                                 | HSBC Asset Management (USA) Inc.                 |   |
| US High Yield Bond                             | HSBC Asset Management (USA) Inc.                 |   |
| US Short Duration High Yield Bond <sup>2</sup> | HSBC Asset Management (USA) Inc.                 | HSBC Asset Management (France), um für einen Teil des Teilfondsportfolios Anlageverwaltungsdienste mit Dispositionsbefugnis zur Verfügung zu stellen.                           |
| <b>Sonstige Teilfonds</b>                      |  |   |
| Global Emerging Markets Multi-Asset Income     | HSBC Asset Management (UK) Limited               | HSBC Asset Management (USA) Inc., um für einen Teil des Teilfondsportfolios Anlageverwaltungsdienste mit Dispositionsbefugnis zur Verfügung zu stellen.                         |
| Managed Solutions – Asia Focused Conservative  | HSBC Global Asset Management (Hong Kong) Limited |   |
| Managed Solutions – Asia Focused Growth        | HSBC Global Asset Management (Hong Kong) Limited |   |
| Managed Solutions – Asia Focused Income        | HSBC Global Asset Management (Hong Kong) Limited |   |
| Multi-Asset Style Factors                      | HSBC Asset Management (France)                   |   |
| Multi-Strategy Target Return                   | HSBC Asset Management (France)                   |   |
| US Income Focused                              | HSBC Asset Management (UK) Limited               |   |

<sup>2</sup> Bis zum 3. Juli 2023 lautete der Name des Teilfonds „Global Short Duration High Yield Bond“.

# Anhang VI (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Risikomanagement

## Allgemeine Informationen

HSBC Investment Funds (Luxembourg) S.A. (die „Verwaltungsgesellschaft“) wendet ein Risikomanagementverfahren an, das das Risiko von Portfoliopositionen und deren Anteil am allgemeinen Risikoprofil der Portfolios der verwalteten Fonds jederzeit überwacht. In Übereinstimmung mit dem Gesetz vom 17. Dezember 2010 und den anwendbaren aufsichtsbehördlichen Regelungen der Commission de Surveillance du Secteur Financier („CSSF“) erstattet die Verwaltungsgesellschaft an die CSSF regelmäßig Bericht über ihr Risikomanagementverfahren. Die Verwaltungsgesellschaft stellt mithilfe angemessener und geeigneter Methoden sicher, dass das allgemeine Risiko in Zusammenhang mit Derivaten den Nettoinventarwert auf Portfolioebene nicht übersteigt. Die Verwaltungsgesellschaft setzt dabei folgende Methoden ein:

## Commitment-Ansatz

Der „Commitment-Ansatz“ basiert auf der Umrechnung von Positionen in derivativen Finanzinstrumenten („FDI“) in deren entsprechende Basiswerte mithilfe des Delta-Ansatzes. Für derivative Finanzinstrumente und deren Basiswerte können eine gegenseitige Aufrechnung oder Absicherungen einbezogen werden, soweit der Ansatz den Vorschriften entspricht. Die Summe dieser entsprechenden Basiswerte darf den Nettoinventarwert des Fonds nicht übersteigen.

Beim **Value-at-Risk** („**VaR**“) handelt es sich um einen mathematischen Ansatz zur Schätzung des potenziellen Verlusts eines Portfolios über eine bestimmte Haltedauer bei einem bestimmten Konfidenzniveau. Der VaR kann auf absoluter oder relativer Basis berechnet werden.

### Absoluter VaR-Ansatz

Beim absoluten VaR-Ansatz darf der VaR des Fonds (bei einem Konfidenzniveau von 99 % und einer Haltedauer von 20 Tagen) 20 % des Nettoinventarwerts des Fonds nicht übersteigen.

### Relativer VaR-Ansatz

Der relative VaR wird unter Bezugnahme auf einen geeigneten Vergleichsindex oder ein Referenzportfolio berechnet. Bei Verwendung dieses Ansatzes darf der relative VaR maximal das Doppelte (200 %) des VaR des Referenzportfolios betragen. Das Referenzportfolio ist ein der Anlagepolitik des Fonds entsprechendes Portfolio.

Das UK und das India GSC Risk Team von HSBC Global Asset Management Limited ist für das Festlegen, Aufrechterhalten und Ausführen des APT-Risikomodells sowie dafür verantwortlich, dass den lokalen Risikoteams entsprechende Analysen und Berichte zur Nutzung zur Verfügung stehen. Die lokalen Risikoteams (AMUS, AMFR, AMHK und UK Risk Team) sind für die Überprüfung und Bewertung der Ergebnisse, das Anwenden der Management Action Trigger-Niveaus („MAT“), die Nachbereitung mit den Fondsmanagern und die Erstellung der von der Verwaltungsgesellschaft benötigten Berichte verantwortlich.

Die Berechnung des VaR erfolgt in Anlehnung an die folgenden Berechnungsstandards und gemäß den in den ESMA-Leitlinien 10/788 Box 15 und CSSF CR 11/512 definierten Standards:

- a) Konfidenzintervall: 99 %
- b) Simulationshorizont: 4 Wochen.
- c) Zeitfenster für die Modellschätzung von 180 Wochen (3,5 Jahre) zum Kalibrieren der Korrelationsstruktur des Modells.
- d) Tägliche VaR-Berechnung mit täglich aktualisierten Daten

Zurzeit verwendet das Risikoteam den APT-parametrischen VaR-Ansatz. Seit dem 1. Januar 2023 wird das Monte-Carlo-VaR-Modell für die Überwachung des Multi-Asset Style Factors-Teilfonds verwendet.

Die (höchste, geringste und durchschnittliche) Ausnutzung des VaR durch den Teilfonds errechnet sich aus der Division des realisierten täglichen VaR (niedrigster, höchster und durchschnittlicher Wert während des Berichtszeitraums) durch die aufsichtsrechtliche VaR-Grenze (20 % für Teilfonds mit absolutem VaR und 200 % für Teilfonds mit relativem VaR).

# Anhang VI (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Risikomanagement (Fortsetzung)

| Teilfonds   | Mit Überwachung nach dem Commitment-/VaR-Ansatz beauftragtes Organ | Beginn     | Ende       | Ansatz zur Berechnung des Marktrisikos | Niedrigster VaR des Fonds Verwendung | Höchster VaR des Fonds Verwendung | Durchschnitt VaR des Fonds Verwendung | Aufsichtsrechtliche VaR-Grenze | Referenzportfolio (soweit vorhanden)                 |
|---|--|------------|------------|--|--------------------------------------|-----------------------------------|---------------------------------------|--------------------------------|--|
| <b>1) Rententeilfonds</b>   |  |            |            |  |                                      |                                   |                                       |                                |  |
| Asia Bond   | HSBC Asset Management (Hong Kong) Limited                          | 01.04.2023 | 31.03.2024 | Commitment-Ansatz                      | n. z.                                | n. z.                             | n. z.                                 | n. z.                          | n. z.  |
| Asia ESG Bond   | HSBC Asset Management (Hong Kong) Limited                          | 01.04.2023 | 31.03.2024 | Commitment-Ansatz                      | n. z.                                | n. z.                             | n. z.                                 | n. z.                          | n. z.  |
| Asia High Yield Bond  | HSBC Asset Management (Hong Kong) Limited                          | 01.04.2023 | 31.03.2024 | Commitment-Ansatz                      | n. z.                                | n. z.                             | n. z.                                 | n. z.                          | n. z.  |
| Asian Currencies Bond   | HSBC Asset Management (Hong Kong) Limited                          | 01.04.2023 | 31.03.2024 | Commitment-Ansatz                      | n. z.                                | n. z.                             | n. z.                                 | n. z.                          | n. z.  |
| Brazil Bond   | HSBC Asset Management (USA) Inc.                                   | 01.04.2023 | 31.03.2024 | Relativer VaR                          | 49,55 %                              | 52,26 %                           | 50,06 %                               | 200,00 %                       | JP Morgan GBI-EM Global Brazil                       |
| Corporate Euro Bond Fixed Term 2027 (aufgelegt zum 30. Juni 2023) | HSBC Asset Management (France) Limited                             | 30.06.2023 | 31.03.2024 | Commitment-Ansatz                      | n. z.                                | n. z.                             | n. z.                                 | n. z.                          | n. z.  |
| Euro Bond   | HSBC Asset Management (France) Limited                             | 01.04.2023 | 31.03.2024 | Commitment-Ansatz                      | n. z.                                | n. z.                             | n. z.                                 | n. z.                          | n. z.  |
| Euro Bond Total Return  | HSBC Asset Management (France) Limited                             | 01.04.2023 | 31.03.2024 | Absoluter VaR                          | 11,93 %                              | 18,74 %                           | 14,54 %                               | 20,00 %                        | n. z.  |
| Euro Credit Bond  | HSBC Asset Management (France) Limited                             | 01.04.2023 | 31.03.2024 | Commitment-Ansatz                      | n. z.                                | n. z.                             | n. z.                                 | n. z.                          | n. z.  |
| Euro High Yield Bond  | HSBC Asset Management (France) Limited                             | 01.04.2023 | 31.03.2024 | Commitment-Ansatz                      | n. z.                                | n. z.                             | n. z.                                 | n. z.                          | n. z.  |
| ESG Short Duration Credit Bond                                    | HSBC Asset Management (USA) Inc.                                   | 01.04.2023 | 31.03.2024 | Absoluter VaR                          | 10,74 %                              | 14,98 %                           | 13,10 %                               | 20,00 %                        | n. z.  |
| GEM Debt Total Return   | HSBC Asset Management (USA) Inc.                                   | 01.04.2023 | 31.03.2024 | Absoluter VaR                          | 11,37 %                              | 27,38 %                           | 19,25 %                               | 20,00 %                        | n. z.  |
| Global Bond   | HSBC Asset Management (UK) Limited                                 | 01.04.2023 | 31.03.2024 | Relativer VaR                          | 52,07 %                              | 59,79 %                           | 56,43 %                               | 200,00 %                       | Bloomberg Global Aggregate                           |
| Global Bond Total Return  | HSBC Asset Management (UK) Limited                                 | 01.04.2023 | 31.03.2024 | Absoluter VaR                          | 15,77 %                              | 21,55 %                           | 19,20 %                               | 20,00 %                        | n. z.  |
| Global Corporate Bond   | HSBC Asset Management (USA) Inc.                                   | 01.04.2023 | 31.03.2024 | Relativer VaR                          | 46,35 %                              | 54,70 %                           | 51,97 %                               | 200,00 %                       | Bloomberg Global Aggregate Corporates AWS Hedged USD |



# Anhang VI (Ungeprüfte Angaben) – Risikomanagement (Fortsetzung)

| Teilfonds  | Mit Überwachung nach dem Commitment-/VaR-Ansatz beauftragtes Organ | Beginn     | Ende       | Ansatz zur Berechnung des Marktrisikos | Niedrigster VaR des Fonds Verwendung | Höchster VaR des Fonds Verwendung | Durchschnitt VaR des Fonds Verwendung | Aufsichtsrechtliche VaR-Grenze | Referenzportfolio (soweit vorhanden)   |
|--|--|------------|------------|--|--------------------------------------|-----------------------------------|---------------------------------------|--------------------------------|--|
| <b>1) Rententeilfonds (Fortsetzung)</b>            |  |            |            |  |                                      |                                   |                                       |                                |  |
| Global Emerging Markets Bond                       | HSBC Asset Management (USA) Inc.                                   | 01.04.2023 | 31.03.2024 | Relativer VaR                          | 48,21 %                              | 52,92 %                           | 50,74 %                               | 200,00 %                       | JP Morgan EMBI Global Diversified  |
| Global Emerging Markets Corporate Sustainable Bond | HSBC Asset Management (UK) Limited                                 | 01.04.2023 | 31.03.2024 | Relativer VaR                          | 51,44 %                              | 75,63 %                           | 65,14 %                               | 200,00 %                       | JP Morgan ESG Corporate EMBI Broad Diversified   |
| Global Emerging Markets ESG Bond                   | HSBC Asset Management (USA) Inc.                                   | 01.04.2023 | 31.03.2024 | Relativer VaR                          | 47,29 %                              | 56,16 %                           | 51,01 %                               | 200,00 %                       | JP Morgan ESG EMBI Global Diversified  |
| Global Emerging Markets ESG Local Debt             | HSBC Asset Management (USA) Inc.                                   | 01.04.2023 | 31.03.2024 | Relativer VaR                          | 49,50 %                              | 53,19 %                           | 51,89 %                               | 200,00 %                       | JP Morgan GBI-EM Global Diversified  |
| Global Emerging Markets Local Debt                 | HSBC Asset Management (USA) Inc.                                   | 01.04.2023 | 31.03.2024 | Relativer VaR                          | 50,46 %                              | 54,67 %                           | 52,48 %                               | 200,00 %                       | 50 % JP Morgan ESG GBI-EM Global Diversified und 50 % JP Morgan ELM+                       |
| Global ESG Corporate Bond                          | HSBC Asset Management (USA) Inc.                                   | 01.04.2023 | 31.03.2024 | Relativer VaR                          | 49,26 %                              | 56,30 %                           | 52,65 %                               | 200,00 %                       | Bloomberg Global Aggregate Corporates Diversified Hedged USD                               |
| Global Government Bond                             | HSBC Asset Management (UK) Limited                                 | 01.04.2023 | 31.03.2024 | Relativer VaR                          | 55,01 %                              | 63,48 %                           | 60,65 %                               | 200,00 %                       | JP Morgan GBI Global Hedged USD  |
| Global Green Bond                                  | HSBC Asset Management (France) Limited                             | 01.04.2023 | 31.03.2024 | Commitment-Ansatz                      | n. z.                                | n. z.                             | n. z.                                 | n. z.                          | n. z.  |
| Global High Income Bond                            | HSBC Asset Management (USA) Inc.                                   | 01.04.2023 | 31.03.2024 | Relativer VaR                          | 47,49 %                              | 55,02 %                           | 51,29 %                               | 200,00 %                       | Bloomberg Global Aggregate Corporate USD Hedged  |
| Global High Yield Bond                             | HSBC Asset Management (USA) Inc.                                   | 01.04.2023 | 31.03.2024 | Relativer VaR                          | 44,00 %                              | 59,75 %                           | 49,46 %                               | 200,00 %                       | (ab 3. Juli 2023) ICE BofA BB-B Developed Market High Yield Constrained Index (USD Hedged) |
| Global High Yield ESG Bond                         | HSBC Asset Management (USA) Inc.                                   | 01.04.2023 | 31.03.2024 | Relativer VaR                          | 46,99 %                              | 57,75 %                           | 51,39 %                               | 200,00 %                       | (ab 3. Juli 2023) ICE BofA BB-B Developed Market High Yield Constrained Index (USD Hedged) |

# Anhang VI (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Risikomanagement (Fortsetzung)

| Teilfonds                                       | Mit Überwachung nach dem Commitment-/VaR-Ansatz beauftragtes Organ | Beginn     | Ende       | Ansatz zur Berechnung des Marktrisikos | Niedrigster VaR des Fonds Verwendung | Höchster VaR des Fonds Verwendung | Durchschnitt VaR des Fonds Verwendung | Aufsichtsrechtliche VaR-Grenze | Referenzportfolio (soweit vorhanden)   |
|---|--|------------|------------|--|--------------------------------------|-----------------------------------|---------------------------------------|--------------------------------|--|
| <b>1) Rententeilfonds (Fortsetzung)</b>         |  |            |            |  |                                      |                                   |                                       |                                |  |
| Global High Yield Securitised Credit Bond       | HSBC Asset Management (UK) Limited                                 | 01.04.2023 | 31.03.2024 | Commitment-Ansatz                      | n. z.                                | n. z.                             | n. z.                                 | n. z.                          | n. z.  |
| Global Inflation Linked Bond                    | HSBC Asset Management (UK) Limited                                 | 01.04.2023 | 31.03.2024 | Relativer VaR                          | 49,53 %                              | 57,76 %                           | 54,25 %                               | 200,00 %                       | ICE BofA Global Inflation-Linked Government Alternative Weighting Scheme Custom (USD hedged) |
| Global Investment Grade Securitised Credit Bond | HSBC Asset Management (UK) Limited                                 | 01.04.2023 | 31.03.2024 | Commitment-Ansatz                      | n. z.                                | n. z.                             | n. z.                                 | n. z.                          | n. z.  |
| Global Lower Carbon Bond                        | HSBC Asset Management (USA) Inc.                                   | 01.04.2023 | 31.03.2024 | Relativer VaR                          | 47,83 %                              | 57,09 %                           | 52,52 %                               | 200,00 %                       | Bloomberg Global Aggregate Corporate Diversified Hedged USD                                  |
| Global Securitised Credit Bond                  | HSBC Asset Management (UK) Limited                                 | 01.04.2023 | 31.03.2024 | Commitment-Ansatz                      | n. z.                                | n. z.                             | n. z.                                 | n. z.                          | n. z.  |
| Global Short Duration Bond                      | HSBC Asset Management (UK) Limited                                 | 01.04.2023 | 31.03.2024 | Absoluter VaR                          | 5,24 %                               | 8,02 %                            | 6,81 %                                | 20,00 %                        | n. z.  |
| India Fixed Income                              | HSBC Asset Management (Hong Kong) Limited                          | 01.04.2023 | 31.03.2024 | Commitment-Ansatz                      | n. z.                                | n. z.                             | n. z.                                 | n. z.                          | n. z.  |
| RMB Fixed Income                                | HSBC Asset Management (Hong Kong) Limited                          | 01.04.2023 | 31.03.2024 | Commitment-Ansatz                      | n. z.                                | n. z.                             | n. z.                                 | n. z.                          | n. z.  |
| Singapore Dollar Income Bond                    | HSBC Asset Management (Hong Kong) Limited                          | 01.04.2023 | 31.03.2024 | Commitment-Ansatz                      | n. z.                                | n. z.                             | n. z.                                 | n. z.                          | n. z.  |
| Ultra Short Duration Bond                       | HSBC Asset Management (USA) Inc.                                   | 01.04.2023 | 31.03.2024 | Commitment-Ansatz                      | n. z.                                | n. z.                             | n. z.                                 | n. z.                          | n. z.  |
| US Dollar Bond                                  | HSBC Asset Management (USA) Inc.                                   | 01.04.2023 | 31.03.2024 | Relativer VaR                          | 51,40 %                              | 63,05 %                           | 57,03 %                               | 200,00 %                       | Bloomberg US Aggregate   |

# Anhang VI (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Risikomanagement (Fortsetzung)

| Teilfonds   | Mit Überwachung nach dem Commitment-/VaR-Ansatz beauftragtes Organ | Beginn     | Ende       | Ansatz zur Berechnung des Marktrisikos | Niedrigster VaR des Fonds Verwendung | Höchster VaR des Fonds Verwendung | Durchschnitt VaR des Fonds Verwendung | Aufsichtsrechtliche VaR-Grenze | Referenzportfolio (soweit vorhanden)                                       |
|---|--|------------|------------|--|--------------------------------------|-----------------------------------|---------------------------------------|--------------------------------|--|
| <b>1) Rententeilfonds (Fortsetzung)</b>   |  |            |            |  |                                      |                                   |                                       |                                |  |
| US High Yield Bond  | HSBC Asset Management (USA) Inc.                                   | 01.04.2023 | 31.03.2024 | Relativer VaR                          | 49,78 %                              | 57,45 %                           | 53,10 %                               | 200,00 %                       | ICE BofA US High Yield Constrained   |
| US Short Duration High Yield Bond (bis zum 2. Juli 2023 lautete der Name des Teilfonds Global Short Duration High Yield Bond) | HSBC Asset Management (USA) Inc.                                   | 01.04.2023 | 02.07.2023 | Relativer VaR                          | 34,44 %                              | 40,54 %                           | 37,43 %                               | 200,00 %                       | Bloomberg Global Short Duration High Yield BB-B 2 % Constrained USD Hedged |
|   |  | 03.07.2023 | 31.03.2024 | Absoluter VaR                          | 20,76 %                              | 29,66 %                           | 24,83 %                               | 20 %                           | n. z.  |
| <b>2) Aktienteilfonds</b>   |  |            |            |  |                                      |                                   |                                       |                                |  |
| Asia ex Japan Equity  | HSBC Asset Management (Hong Kong) Limited                          | 01.04.2023 | 31.03.2024 | Commitment-Ansatz                      | n. z.                                | n. z.                             | n. z.                                 | n. z.                          | n. z.  |
| Asia ex Japan Equity Smaller Companies  | HSBC Asset Management (Hong Kong) Limited                          | 01.04.2023 | 31.03.2024 | Commitment-Ansatz                      | n. z.                                | n. z.                             | n. z.                                 | n. z.                          | n. z.  |
| Asia Pacific ex Japan Equity High Dividend  | HSBC Asset Management (Hong Kong) Limited                          | 01.04.2023 | 31.03.2024 | Commitment-Ansatz                      | n. z.                                | n. z.                             | n. z.                                 | n. z.                          | n. z.  |
| BRIC Equity   | HSBC Asset Management (UK) Limited                                 | 01.04.2023 | 31.03.2024 | Commitment-Ansatz                      | n. z.                                | n. z.                             | n. z.                                 | n. z.                          | n. z.  |
| BRIC Markets Equity   | HSBC Asset Management (UK) Limited                                 | 01.04.2023 | 31.03.2024 | Commitment-Ansatz                      | n. z.                                | n. z.                             | n. z.                                 | n. z.                          | n. z.  |
| China A-Shares Equity   | HSBC Asset Management (Hong Kong) Limited                          | 01.04.2023 | 31.03.2024 | Commitment-Ansatz                      | n. z.                                | n. z.                             | n. z.                                 | n. z.                          | n. z.  |
| Chinese Equity  | HSBC Asset Management (Hong Kong) Limited                          | 01.04.2023 | 31.03.2024 | Commitment-Ansatz                      | n. z.                                | n. z.                             | n. z.                                 | n. z.                          | n. z.  |
| Euroland Equity Smaller Companies   | HSBC Asset Management (France) Limited                             | 01.04.2023 | 31.03.2024 | Commitment-Ansatz                      | n. z.                                | n. z.                             | n. z.                                 | n. z.                          | n. z.  |
| Euroland Growth   | HSBC Asset Management (France) Limited                             | 01.04.2023 | 31.03.2024 | Commitment-Ansatz                      | n. z.                                | n. z.                             | n. z.                                 | n. z.                          | n. z.  |
| Euroland Value  | HSBC Asset Management (France) Limited                             | 01.04.2023 | 31.03.2024 | Commitment-Ansatz                      | n. z.                                | n. z.                             | n. z.                                 | n. z.                          | n. z.  |
| Europe Value  | HSBC Asset Management (France) Limited                             | 01.04.2023 | 31.03.2024 | Commitment-Ansatz                      | n. z.                                | n. z.                             | n. z.                                 | n. z.                          | n. z.  |
| Frontier Markets  | HSBC Asset Management (UK) Limited                                 | 01.04.2023 | 31.03.2024 | Commitment-Ansatz                      | n. z.                                | n. z.                             | n. z.                                 | n. z.                          | n. z.  |
| Global Emerging Markets Equity  | HSBC Asset Management (UK) Limited                                 | 01.04.2023 | 31.03.2024 | Commitment-Ansatz                      | n. z.                                | n. z.                             | n. z.                                 | n. z.                          | n. z.  |

# Anhang VI (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Risikomanagement (Fortsetzung)

| Teilfonds                             | Mit Überwachung nach dem Commitment-/ VaR-Ansatz beauftragtes Organ | Beginn     | Ende       | Ansatz zur Berechnung des Marktrisikos | Niedrigster VaR des Fonds Verwendung | Höchster VaR des Fonds Verwendung | Durchschnitt VaR des Fonds Verwendung | Aufsichtsrechtliche VaR-Grenze | Referenzportfolio (soweit vorhanden) |
|---------------------------------------|---|------------|------------|--|--------------------------------------|-----------------------------------|---------------------------------------|--------------------------------|--------------------------------------|
| <b>2) Aktiiefonds (Fortsetzung)</b>   |   |            |            |  |                                      |                                   |                                       |                                |                                      |
| Global Equity Circular Economy        | HSBC Asset Management (France) Limited                              | 01.04.2023 | 31.03.2024 | Commitment-Ansatz                      | n. z.                                | n. z.                             | n. z.                                 | n. z.                          | n. z.                                |
| Global Equity Climate Change          | HSBC Asset Management (UK) Limited                                  | 01.04.2023 | 31.03.2024 | Commitment-Ansatz                      | n. z.                                | n. z.                             | n. z.                                 | n. z.                          | n. z.                                |
| Global Equity Sustainable Healthcare  | HSBC Asset Management (France) Limited                              | 01.04.2023 | 31.03.2024 | Commitment-Ansatz                      | n. z.                                | n. z.                             | n. z.                                 | n. z.                          | n. z.                                |
| Global Equity Volatility Focused      | HSBC Asset Management (UK) Limited                                  | 01.04.2023 | 31.03.2024 | Commitment-Ansatz                      | n. z.                                | n. z.                             | n. z.                                 | n. z.                          | n. z.                                |
| Global Infrastructure Equity          | HSBC Asset Management (UK) Limited                                  | 01.04.2023 | 31.03.2024 | Commitment-Ansatz                      | n. z.                                | n. z.                             | n. z.                                 | n. z.                          | n. z.                                |
| Global Lower Carbon Equity            | HSBC Asset Management (UK) Limited                                  | 01.04.2023 | 31.03.2024 | Commitment-Ansatz                      | n. z.                                | n. z.                             | n. z.                                 | n. z.                          | n. z.                                |
| Global Real Estate Equity             | HSBC Asset Management (UK) Limited                                  | 01.04.2023 | 31.03.2024 | Commitment-Ansatz                      | n. z.                                | n. z.                             | n. z.                                 | n. z.                          | n. z.                                |
| Global Sustainable Equity Income      | HSBC Asset Management (France) Limited                              | 01.04.2023 | 31.03.2024 | Commitment-Ansatz                      | n. z.                                | n. z.                             | n. z.                                 | n. z.                          | n. z.                                |
| Global Sustainable Long Term Dividend | HSBC Asset Management (UK) Limited                                  | 01.04.2023 | 31.03.2024 | Commitment-Ansatz                      | n. z.                                | n. z.                             | n. z.                                 | n. z.                          | n. z.                                |
| Global Sustainable Long Term Equity   | HSBC Asset Management (UK) Limited                                  | 01.04.2023 | 31.03.2024 | Commitment-Ansatz                      | n. z.                                | n. z.                             | n. z.                                 | n. z.                          | n. z.                                |
| Hong Kong Equity                      | HSBC Asset Management (Hong Kong) Limited                           | 01.04.2023 | 31.03.2024 | Commitment-Ansatz                      | n. z.                                | n. z.                             | n. z.                                 | n. z.                          | n. z.                                |

# Anhang VI (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Risikomanagement (Fortsetzung)

| Teilfonds  | Mit Überwachung nach dem Commitment-/VaR-Ansatz beauftragtes Organ | Beginn     | Ende       | Ansatz zur Berechnung des Marktrisikos | Niedrigster VaR des Fonds Verwendung | Höchster VaR des Fonds Verwendung | Durchschnitt VaR des Fonds Verwendung | Aufsichtsrechtliche VaR-Grenze | Referenzportfolio (soweit vorhanden) |
|--|--|------------|------------|--|--------------------------------------|-----------------------------------|---------------------------------------|--------------------------------|--------------------------------------|
| <b>3) Marktspezifische Aktienteilfonds (Fortsetzung)</b>                                 |  |            |            |  |                                      |                                   |                                       |                                |                                      |
| ASEAN Equity ( bis zum 31. Juli 2023 lautete der Name des Teilfonds „Thai Equity“)       | HSBC Asset Management (Hong Kong) Limited                          | 01.04.2023 | 31.03.2024 | Commitment-Ansatz                      | n. z.                                | n. z.                             | n. z.                                 | n. z.                          | n. z.                                |
| Brazil Equity  | HSBC Asset Management (UK) Limited                                 | 01.04.2023 | 31.03.2024 | Commitment-Ansatz                      | n. z.                                | n. z.                             | n. z.                                 | n. z.                          | n. z.                                |
| Economic Scale US Equity   | HSBC Asset Management (UK) Limited                                 | 01.04.2023 | 31.03.2024 | Commitment-Ansatz                      | n. z.                                | n. z.                             | n. z.                                 | n. z.                          | n. z.                                |
| Indian Equity  | HSBC Asset Management (Hong Kong) Limited                          | 01.04.2023 | 31.03.2024 | Commitment-Ansatz                      | n. z.                                | n. z.                             | n. z.                                 | n. z.                          | n. z.                                |
| Mexico Equity (geschlossen zum 28. Juli 2023)  | HSBC Asset Management (Mexico) S.A.                                | 01.04.2023 | 28.07.2023 | Commitment-Ansatz                      | n. z.                                | n. z.                             | n. z.                                 | n. z.                          | n. z.                                |
| Russia Equity  | HSBC Asset Management (UK) Limited                                 | 01.04.2023 | 31.03.2024 | Commitment-Ansatz                      | n. z.                                | n. z.                             | n. z.                                 | n. z.                          | n. z.                                |
| Turkey Equity  | HSBC Global Portfoy Yonetimi A.S.                                  | 01.04.2023 | 31.03.2024 | Commitment-Ansatz                      | n. z.                                | n. z.                             | n. z.                                 | n. z.                          | n. z.                                |
| <b>4) Sonstige Teilfonds</b>   |  |            |            |  |                                      |                                   |                                       |                                |                                      |
| Global Credit Floating Rate Fixed Term Bond 2023 – 1 (geschlossen zum 5. Juli 2023)      | HSBC Asset Management (USA) Inc.                                   | 01.04.2023 | 05.07.2023 | Commitment-Ansatz                      | n. z.                                | n. z.                             | n. z.                                 | n. z.                          | n. z.                                |
| Global Credit Floating Rate Fixed Term Bond 2023 – 2 (geschlossen zum 29. Dezember 2023) | HSBC Asset Management (USA) Inc.                                   | 01.04.2023 | 29.12.2023 | Commitment-Ansatz                      | n. z.                                | n. z.                             | n. z.                                 | n. z.                          | n. z.                                |
| Global Emerging Markets Multi-Asset Income   | HSBC Asset Management (UK) Limited                                 | 01.04.2023 | 31.03.2024 | Commitment-Ansatz                      | n. z.                                | n. z.                             | n. z.                                 | n. z.                          | n. z.                                |
| Managed Solutions – Asia Focused Conservative  | HSBC Asset Management (Hong Kong) Limited                          | 01.04.2023 | 31.03.2024 | Commitment-Ansatz                      | n. z.                                | n. z.                             | n. z.                                 | n. z.                          | n. z.                                |

# Anhang VI (Ungeprüfte Angaben) – Risikomanagement (Fortsetzung)

| Teilfonds                                  | Mit Überwachung nach dem Commitment-/VaR-Ansatz beauftragtes Organ | Beginn     | Ende       | Ansatz zur Berechnung des Marktrisikos | Niedrigster VaR des Fonds Verwendung | Höchster VaR des Fonds Verwendung | Durchschnitt VaR des Fonds Verwendung | Aufsichtsrechtliche VaR-Grenze | Referenzportfolio (soweit vorhanden) |
|--|--|------------|------------|--|--------------------------------------|-----------------------------------|---------------------------------------|--------------------------------|--------------------------------------|
| <b>4) Sonstige Teilfonds (Fortsetzung)</b> |  |            |            |  |                                      |                                   |                                       |                                |                                      |
| Managed Solutions – Asia Focused Growth    | HSBC Asset Management (Hong Kong) Limited                          | 01.04.2023 | 31.03.2024 | Commitment-Ansatz                      | n. z.                                | n. z.                             | n. z.                                 | n. z.                          | n. z.                                |
| Managed Solutions – Asia Focused Income    | HSBC Asset Management (Hong Kong) Limited                          | 01.04.2023 | 31.03.2024 | Commitment-Ansatz                      | n. z.                                | n. z.                             | n. z.                                 | n. z.                          | n. z.                                |
| Multi-Asset Style Factors                  | HSBC Asset Management (France) Limited                             | 01.04.2023 | 31.03.2024 | Absoluter VaR                          | 17,54 %                              | 34,57 %                           | 25,14 %                               | 20,00 %                        | n. z.                                |
| Multi-Strategy Target Return               | HSBC Asset Management (France) Limited                             | 01.04.2023 | 31.03.2024 | Absoluter VaR                          | 11,88 %                              | 29,22 %                           | 22,27 %                               | 20,00 %                        | n. z.                                |
| US Income Focused                          | HSBC Asset Management (UK) Limited                                 | 01.04.2023 | 31.03.2024 | Commitment-Ansatz                      | n. z.                                | n. z.                             | n. z.                                 | n. z.                          | n. z.                                |

# Anhang VI (Ungeprüfte Angaben) – Risikomanagement (Fortsetzung)

## Methodik der Hebelwirkung

Für Teilfonds, die das Gesamtrisiko durch Derivate mit dem VaR-Ansatz messen und überwachen, hat die Verwaltungsgesellschaft die Überwachung der Hebelwirkung den Anlageberatern der jeweiligen Teilfonds übertragen, die die Summe der Nominalwerte aller maßgeblichen Finanzderivate berechnen und diesbezüglich den Grad des erwarteten durchschnittlichen Wertes schätzen (Hebelwirkung). Dieses Maß an Hebelwirkung kann je nach Marktbedingungen vom tatsächlichen Wert zum Berichtszeitpunkt abweichen. Das veröffentlichte erwartete Maß an Hebelwirkung versteht sich ausdrücklich nicht als Anlagebeschränkung.

Für die Teilfonds, die die Value-at-Risk-Methode verwenden, wurde die Hebelwirkung unter Verwendung der Methode der Summe der Nominalwerte für den gesamten Zeitraum berechnet.

| Teilfonds   | Beginn Berichtszeitraum | Ende Berichtszeitraum | Methodik der Hebelwirkung | Erwartete Hebelung | Tatsächliche durchschnittliche Hebelung |
|---|-------------------------|-----------------------|---------------------------|--------------------|---|
| <b>1) Rententeilfonds</b>                           |                         |                       |                           |                    |   |
| Brazil Bond   | 01.04.2023              | 31.03.2024            | Summe der Nominalwerte    | 50,00 %            | 4,39 %                                  |
| Euro Bond Total Return                              | 01.04.2023              | 31.03.2024            | Summe der Nominalwerte    | 120,00 %           | 58,31 %                                 |
| GEM Debt Total Return <sup>1</sup>                  | 01.04.2023              | 31.03.2024            | Summe der Nominalwerte    | 200,00 %           | 197,55 %                                |
| Global Bond   | 01.04.2023              | 31.03.2024            | Summe der Nominalwerte    | 150,00 %           | 65,95 %                                 |
| Global Bond Total Return                            | 01.04.2023              | 31.03.2024            | Summe der Nominalwerte    | 300,00 %           | 156,74 %                                |
| Global Corporate Bond <sup>2</sup>                  | 01.04.2023              | 31.03.2024            | Summe der Nominalwerte    | 75,00 %            | 71,47 %                                 |
| Global Emerging Markets Bond <sup>3</sup>           | 01.04.2023              | 31.03.2024            | Summe der Nominalwerte    | 50,00 %            | 45,96 %                                 |
| Global Emerging Markets Corporate Sustainable Bond  | 01.04.2023              | 31.03.2024            | Summe der Nominalwerte    | 50,00 %            | 15,10 %                                 |
| Global Emerging Markets ESG Local Debt <sup>4</sup> | 01.04.2023              | 31.03.2024            | Summe der Nominalwerte    | 150,00 %           | 115,13 %                                |
| Global Emerging Markets Local Debt <sup>5</sup>     | 01.04.2023              | 31.03.2024            | Summe der Nominalwerte    | 200,00 %           | 179,43 %                                |
| Global ESG Corporate Bond <sup>6</sup>              | 01.04.2023              | 31.03.2024            | Summe der Nominalwerte    | 75,00 %            | 78,42 %                                 |
| ESG Short Duration Credit Bond                      | 01.04.2023              | 31.03.2024            | Summe der Nominalwerte    | 50,00 %            | 21,10 %                                 |
| Global Emerging Markets ESG Bond <sup>7</sup>       | 01.04.2023              | 31.03.2024            | Summe der Nominalwerte    | 50,00 %            | 41,36 %                                 |
| Global Government Bond                              | 01.04.2023              | 31.03.2024            | Summe der Nominalwerte    | 150,00 %           | 90,27 %                                 |
| Global High Income Bond <sup>8</sup>                | 01.04.2023              | 31.03.2024            | Summe der Nominalwerte    | 75,00 %            | 64,58 %                                 |
| Global High Yield Bond                              | 01.04.2023              | 31.03.2024            | Summe der Nominalwerte    | 75,00 %            | 30,34 %                                 |

<sup>1</sup> Das erwartete Maß an Hebelwirkung des Fonds wird in der nächsten unmittelbar bevorstehenden Aktualisierung des Prospekts auf 500 % geändert werden.

<sup>2</sup> Das erwartete Maß an Hebelwirkung des Fonds wird in der nächsten unmittelbar bevorstehenden Aktualisierung des Prospekts auf 125 % geändert werden.

<sup>3</sup> Das erwartete Maß an Hebelwirkung des Fonds wird in der nächsten unmittelbar bevorstehenden Aktualisierung des Prospekts auf 100 % geändert werden.

<sup>4</sup> Das erwartete Maß an Hebelwirkung des Fonds wird in der nächsten unmittelbar bevorstehenden Aktualisierung des Prospekts auf 300 % geändert werden.

<sup>5</sup> Das erwartete Maß an Hebelwirkung des Fonds wird in der nächsten unmittelbar bevorstehenden Aktualisierung des Prospekts auf 400 % geändert werden.

<sup>6</sup> Das erwartete Maß an Hebelwirkung des Fonds wird in der nächsten unmittelbar bevorstehenden Aktualisierung des Prospekts auf 125 % geändert werden.

<sup>7</sup> Das erwartete Maß an Hebelwirkung des Fonds wird in der nächsten unmittelbar bevorstehenden Aktualisierung des Prospekts auf 100 % geändert werden.

<sup>8</sup> Das erwartete Maß an Hebelwirkung des Fonds wird in der nächsten unmittelbar bevorstehenden Aktualisierung des Prospekts auf 125 % geändert werden.

# Anhang VI (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Risikomanagement (Fortsetzung)

| Teilfonds   | Beginn<br>Berichtszeitraum | Ende<br>Berichtszeitraum | Methodik der Hebelwirkung | Erwartete<br>Hebelung | Tatsächliche<br>durchschnittliche<br>Hebelung |
|---|----------------------------|--------------------------|---------------------------|-----------------------|---|
| Global High Yield ESG Bond  | 01.04.2023                 | 31.03.2024               | Summe der Nominalwerte    | 75,00 %               | 30,61 %                                       |
| Global Inflation Linked Bond  | 01.04.2023                 | 31.03.2024               | Summe der Nominalwerte    | 150,00 %              | 95,70 %                                       |
| Global Lower Carbon Bond <sup>9</sup>   | 01.04.2023                 | 31.03.2024               | Summe der Nominalwerte    | 75,00 %               | 74,11 %                                       |
| Global Short Duration Bond  | 01.04.2023                 | 31.03.2024               | Summe der Nominalwerte    | 200,00 %              | 109,74 %                                      |
| US Short Duration High Yield Bond (bis zum 2. Juli 2023 lautete der Name des Teilfonds Global Short Duration High Yield Bond) | 01.04.2023                 | 31.03.2024               | Summe der Nominalwerte    | 75,00 %               | 30,50 %                                       |
| US Dollar Bond  | 01.04.2023                 | 31.03.2024               | Summe der Nominalwerte    | 75,00 %               | 31,63 %                                       |
| US High Yield Bond  | 01.04.2023                 | 31.03.2024               | Summe der Nominalwerte    | 75,00 %               | 4,43 %  |
| <b>2) Sonstige Teilfonds</b>  |                            |                          |                           |                       |   |
| Multi-Asset Style Factors   | 01.04.2023                 | 31.03.2024               | Summe der Nominalwerte    | 700,00 %              | 401,03 %                                      |
| Multi-Strategy Target Return  | 01.04.2023                 | 31.03.2024               | Summe der Nominalwerte    | 500,00 %              | 413,53 %                                      |

<sup>9</sup> Das erwartete Maß an Hebelwirkung des Fonds wird in der nächsten unmittelbar bevorstehenden Aktualisierung des Prospekts auf 125 % geändert werden.



# Anhang VII (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte („SFT-Verordnung“)

Mit der Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte („SFT-Verordnung“) wurden Meldepflichten in Bezug auf Wertpapierleihgeschäfte und Total Return Swaps eingeführt.

Ein Wertpapierfinanzierungsgeschäft (SFT) ist gemäß Artikel 3 der Verordnung (EU) 2015/2365(11) definiert als:

- ein Pensionsgeschäft/umgekehrtes Pensionsgeschäft;
- ein Wertpapier- oder Warenverleihgeschäft und ein Wertpapier- oder Warenleihgeschäft,
- ein Kauf-/Rückverkaufgeschäft oder ein Verkauf-/Rückkaufgeschäft;
- ein Lombardgeschäft.

Während des Berichtszeitraums zum 31. März 2024 haben mehrere Teilfonds Wertpapierleihgeschäfte getätigt und ein Teilfonds hat in einen Total Return Swap-Vertrag investiert, der in den Geltungsbereich der SFT-Verordnung fällt.

## Allgemeine Angaben

*Betrag des Vermögens, das für Wertpapierleihgeschäfte eingesetzt wird.*

Der Betrag des Vermögens, das für Wertpapierleihgeschäfte eingesetzt wird, einschließlich des Anteils am Gesamtnettvermögen des Teilfonds und an den verleihbaren Vermögenswerten\* insgesamt, stellt sich wie folgt dar:

| Teilfonds                                  | Währung | Art des Vermögenswerts | Marktwert der verliehenen Wertpapiere (in Währung des Teilfonds) | Gesamtnettvermögen | % des Gesamtnettvermögens | % der verleihbaren Vermögenswerte insgesamt |
|--|---------|------------------------|--|--------------------|---------------------------|---|
| Asia ex Japan Equity                       | USD     | Wertpapierleihe        | 6.462.281  |                    | 2,10 %                    | 2,12 %                                      |
| Asia ex Japan Equity Smaller Companies     | USD     | Wertpapierleihe        | 62.639.255   |                    | 15,95 %                   | 16,31 %                                     |
| Asia Pacific ex Japan Equity High Dividend | USD     | Wertpapierleihe        | 9.627.050  |                    | 3,57 %                    | 3,58 %                                      |
| Chinese Equity                             | USD     | Wertpapierleihe        | 10.168.371   |                    | 1,75 %                    | 1,76 %                                      |
| Euroland Equity Smaller Companies          | EUR     | Wertpapierleihe        | 15.940.021   |                    | 15,37 %                   | 15,86 %                                     |
| Euroland Growth                            | EUR     | Wertpapierleihe        | 24.079.718   |                    | 12,05 %                   | 12,12 %                                     |
| Euroland Value                             | EUR     | Wertpapierleihe        | 42.897.752   |                    | 17,03 %                   | 17,36 %                                     |
| Europe Value                               | EUR     | Wertpapierleihe        | 11.808.589   |                    | 19,14 %                   | 19,43 %                                     |
| Global Emerging Markets Equity             | USD     | Wertpapierleihe        | 18.819.331   |                    | 5,11 %                    | 5,20 %                                      |
| Global Lower Carbon Equity                 | USD     | Wertpapierleihe        | 13.670.827   |                    | 3,67 %                    | 3,72 %                                      |
| Global Infrastructure Equity               | USD     | Wertpapierleihe        | 69.872.221   |                    | 7,91 %                    | 7,93 %                                      |
| Global Sustainable Long Term Equity        | USD     | Wertpapierleihe        | 4.340.365  |                    | 4,00 %                    | 4,06 %                                      |
| BRIC Equity                                | USD     | Wertpapierleihe        | 1.218.881  |                    | 1,20 %                    | 1,21 %                                      |
| BRIC Markets Equity                        | USD     | Wertpapierleihe        | 399.071  |                    | 0,99 %                    | 1,00 %                                      |
| Frontier Markets                           | USD     | Wertpapierleihe        | 406.280  |                    | 0,09 %                    | 0,09 %                                      |
| Global Equity Volatility Focused           | USD     | Wertpapierleihe        | 11.905.905   |                    | 9,22 %                    | 9,29 %                                      |
| Global Real Estate Equity                  | USD     | Wertpapierleihe        | 88.996.115   |                    | 13,83 %                   | 14,03 %                                     |
| Economic Scale US Equity                   | USD     | Wertpapierleihe        | 39.020.085   |                    | 14,69 %                   | 14,80 %                                     |
| Indian Equity                              | USD     | Wertpapierleihe        | 6.312.776  |                    | 0,45 %                    | 0,44 %                                      |
| Asia Bond                                  | USD     | Wertpapierleihe        | 75.206.237   |                    | 20,97 %                   | 21,11 %                                     |
| Asia High Yield Bond                       | USD     | Wertpapierleihe        | 131.286.962  |                    | 19,68 %                   | 20,18 %                                     |
| Euro Bond                                  | EUR     | Wertpapierleihe        | 2.523.263  |                    | 4,56 %                    | 4,64 %                                      |
| Euro Bond Total Return                     | EUR     | Wertpapierleihe        | 10.667.898   |                    | 11,46 %                   | 12,68 %                                     |
| Euro Credit Bond                           | EUR     | Wertpapierleihe        | 48.369.122   |                    | 11,38 %                   | 11,64 %                                     |
| Euro High Yield Bond                       | EUR     | Wertpapierleihe        | 133.690.523  |                    | 17,73 %                   | 18,04 %                                     |

\* Bei den verleihbaren Vermögenswerten handelt es sich um Wertpapiere (Aktien und aktienähnliche Instrumente, festverzinsliche Instrumente), die die Verwaltungsgesellschaft im Austausch gegen Sicherheiten vorübergehend an zugelassene Entleiher übertragen kann.

# Anhang VII (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte („SFT-Verordnung“) (Fortsetzung)

## Allgemeine Angaben (Fortsetzung)

| Teilfonds                                     | Währung | Art des Vermögenswerts | Marktwert der verliehenen Wertpapiere (in Währung des Teilfonds) | Gesamtnettovermögens | % des   | % der beleihbaren Vermögenswerte insgesamt |
|---|---------|------------------------|--|----------------------|---------|--|
| GEM Debt Total Return                         | USD     | Wertpapierleihe        | 1.277.728  |                      | 3,47 %  | 3,80 %                                     |
| Global Bond Total Return                      | USD     | Wertpapierleihe        | 13.475.569   |                      | 6,11 %  | 6,32 %                                     |
| Global Corporate Bond                         | USD     | Wertpapierleihe        | 574.321.709  |                      | 17,29 % | 17,57 %                                    |
| Global Emerging Markets Bond                  | USD     | Wertpapierleihe        | 118.144.317  |                      | 11,54 % | 11,66 %                                    |
| Global Emerging Markets Local Debt            | USD     | Wertpapierleihe        | 158.830.524  |                      | 17,30 % | 17,31 %                                    |
| Global Government Bond                        | USD     | Wertpapierleihe        | 964.878.793  |                      | 22,64 % | 22,81 %                                    |
| Global High Income Bond                       | USD     | Wertpapierleihe        | 168.141.235  |                      | 18,99 % | 19,66 %                                    |
| Global High Yield Bond                        | USD     | Wertpapierleihe        | 141.324.055  |                      | 19,48 % | 19,75 %                                    |
| Global Inflation Linked Bond                  | USD     | Wertpapierleihe        | 115.689.297  |                      | 19,82 % | 19,86 %                                    |
| Global Short Duration Bond                    | USD     | Wertpapierleihe        | 266.829.572  |                      | 11,87 % | 11,94 %                                    |
| US Short Duration High Yield Bond*            | USD     | Wertpapierleihe        | 13.786.943   |                      | 14,73 % | 14,86 %                                    |
| Ultra Short Duration Bond                     | USD     | Wertpapierleihe        | 44.792.822   |                      | 4,14 %  | 4,11 %                                     |
| US High Yield Bond                            | USD     | Wertpapierleihe        | 2.139.079  |                      | 4,95 %  | 5,13 %                                     |
| RMB Fixed Income                              | USD     | Wertpapierleihe        | 2.414.721  |                      | 1,10 %  | 1,12 %                                     |
| Singapore Dollar Income Bond                  | SGD     | Wertpapierleihe        | 25.521.992   |                      | 10,17 % | 10,22 %                                    |
| US Dollar Bond                                | USD     | Wertpapierleihe        | 9.900.058  |                      | 2,96 %  | 2,28 %                                     |
| Managed Solutions – Asia Focused Conservative | USD     | Wertpapierleihe        | 300.776  |                      | 0,93 %  | 0,94 %                                     |
| Managed Solutions – Asia Focused Income       | USD     | Wertpapierleihe        | 16.909.763   |                      | 6,10 %  | 6,17 %                                     |
| US Income Focused                             | USD     | Wertpapierleihe        | 21.252.030   |                      | 4,16 %  | 4,06 %                                     |
| Multi-Asset Style Factors                     | EUR     | Wertpapierleihe        | 70.576.146   |                      | 8,58 %  | 10,29 %                                    |

\* Bis zum 3. Juli 2023 lautete der Name des Teilfonds „Global Short Duration High Yield Bond“.

*Betrag des Vermögens, das für Total Return Swap eingesetzt wird.*

Der Betrag des Vermögens, das für Total Return Swap eingesetzt wird, einschließlich des Anteils am Gesamtnettovermögen des Teilfonds, ist nachstehend aufgeführt:

### Multi-Strategy Target Return

| Art des Vermögenswertes | Währung | Nicht realisierter Gewinn in der Währung des Teilfonds | % des Gesamtnettovermögens |
|-------------------------|---------|--|----------------------------|
| Total Return Swap       | EUR     | 429,710  | 0.39                       |

\* Der nicht realisierte Gewinn ist in der Aufstellung der Derivate, Swaps angegeben.

# Anhang VII (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte („SFT-Verordnung“) (Fortsetzung)

## Angaben zur Konzentration

Die zehn größten Emittenten für unbare Sicherheiten im Rahmen von Wertpapierleihgeschäften

### Asia ex Japan Equity

| #  | Emittenten von Sicherheiten          | Währung des Teilfonds | Betrag in Währung des Teilfonds |
|----|--------------------------------------|-----------------------|---------------------------------|
| 1  | NN GROUP NN GROUP ODSH               | USD                   | 762.056                         |
| 2  | CCB CCB ODSH                         | USD                   | 760.577                         |
| 3  | CHINAMRCHNTBANK CHINAMRCHNTBANK ODSH | USD                   | 760.573                         |
| 4  | AIA GROUP AIA GROUP ODSH             | USD                   | 760.571                         |
| 5  | SUN LIFE SUN LIFE ODSH               | USD                   | 760.563                         |
| 6  | BROOKFIELD CO BROOKFIELD CO ODSH     | USD                   | 760.548                         |
| 7  | ICBC ICBC ODSH                       | USD                   | 507.143                         |
| 8  | UK-Regierung                         | USD                   | 352.901                         |
| 9  | LVMH LVMH ODSH                       | USD                   | 267.683                         |
| 10 | TESCO TESCO ODSH                     | USD                   | 267.192                         |

### Asia ex Japan Equity Smaller Companies

| #  | Emittenten von Sicherheiten | Währung des Teilfonds | Betrag in Währung des Teilfonds |
|----|-----------------------------|-----------------------|---------------------------------|
| 1  | US-Regierung                | USD                   | 28.628.807                      |
| 2  | Regierung von Japan         | USD                   | 14.439.687                      |
| 3  | UK-Regierung                | USD                   | 3.302.732                       |
| 4  | Regierung von Österreich    | USD                   | 2.853.272                       |
| 5  | Regierung von Frankreich    | USD                   | 2.540.109                       |
| 6  | Regierung von Belgien       | USD                   | 2.539.895                       |
| 7  | LVMH LVMH ODSH              | USD                   | 697.599                         |
| 8  | CCB CCB ODSH                | USD                   | 613.589                         |
| 9  | LILLY LILLY ODSH            | USD                   | 507.373                         |
| 10 | NVIDIA NVIDIA ODSH          | USD                   | 507.205                         |

### Asia Pacific ex Japan Equity High Dividend

| # | Emittenten von Sicherheiten            | Währung des Teilfonds | Betrag in Währung des Teilfonds |
|---|--|-----------------------|---------------------------------|
| 1 | RENESAS RENESAS ODSH                   | USD                   | 1.530.239                       |
| 2 | RECRUIT HOLDINGS RECRUIT HOLDINGS ODSH | USD                   | 1.530.181                       |
| 3 | DAIICHI SANKYO DAIICHI SANKYO ODSH     | USD                   | 1.529.596                       |
| 4 | NINTENDO NINTENDO ODSH                 | USD                   | 1.529.519                       |
| 5 | SHIN-ETSU CHEM SHIN-ETSU CHEM ODSH     | USD                   | 1.529.242                       |
| 6 | TOKYO ELECTRON TOKYO ELECTRON ODSH     | USD                   | 1.506.079                       |
| 7 | KDDI KDDI ODSH                         | USD                   | 1.052.041                       |

### Chinese Equity

| #  | Emittenten von Sicherheiten    | Währung des Teilfonds | Betrag in Währung des Teilfonds |
|----|--------------------------------|-----------------------|---------------------------------|
| 1  | Regierung von Japan            | USD                   | 3.475.329                       |
| 2  | MICROSOFT MICROSOFT ODSH       | USD                   | 1.022.811                       |
| 3  | NVIDIA NVIDIA ODSH             | USD                   | 1.022.533                       |
| 4  | HERMES INTL HERMES INTL ODSH   | USD                   | 751.730                         |
| 5  | PROSUS PROSUS ODSH             | USD                   | 745.366                         |
| 6  | ASML HOLDING ASML HOLDING ODSH | USD                   | 745.324                         |
| 7  | ASTRAZENECA ORD USD0.25        | USD                   | 743.804                         |
| 8  | RELX PLC RELX PLC GBP0.1444    | USD                   | 522.559                         |
| 9  | Regierung von Frankreich       | USD                   | 218.709                         |
| 10 | ALIBABA ALIBABA ODSH           | USD                   | 211.072                         |

### Euroland Equity Smaller Companies

| #  | Emittenten von Sicherheiten | Währung des Teilfonds | Betrag in Währung des Teilfonds |
|----|-----------------------------|-----------------------|---------------------------------|
| 1  | Regierung von Japan         | EUR                   | 2.158.366                       |
| 2  | MICROSOFT MICROSOFT ODSH    | EUR                   | 1.851.170                       |
| 3  | NVIDIA NVIDIA ODSH          | EUR                   | 1.850.961                       |
| 4  | EATON CORP EATON CORP ODSH  | EUR                   | 1.453.227                       |
| 5  | ADP ADP ODSH                | EUR                   | 1.453.190                       |
| 6  | ACCENTURE ACCENTURE ODSH    | EUR                   | 1.453.099                       |
| 7  | SALESFORCE SALESFORCE ODSH  | EUR                   | 1.453.042                       |
| 8  | COMCAST COMCAST ODSH        | EUR                   | 969.514                         |
| 9  | US-Regierung                | EUR                   | 898.511                         |
| 10 | UK-Regierung                | EUR                   | 719.626                         |

### Euroland Growth

| #  | Emittenten von Sicherheiten    | Währung des Teilfonds | Betrag in Währung des Teilfonds |
|----|--------------------------------|-----------------------|---------------------------------|
| 1  | MICROSOFT MICROSOFT ODSH       | EUR                   | 3.481.871                       |
| 2  | NVIDIA NVIDIA ODSH             | EUR                   | 3.481.310                       |
| 3  | PROSUS PROSUS ODSH             | EUR                   | 1.979.255                       |
| 4  | ASML HOLDING ASML HOLDING ODSH | EUR                   | 1.978.570                       |
| 5  | HERMES INTL HERMES INTL ODSH   | EUR                   | 1.977.733                       |
| 6  | ASTRAZENECA ORD USD0.25        | EUR                   | 1.975.317                       |
| 7  | EATON CORP EATON CORP ODSH     | EUR                   | 1.509.120                       |
| 8  | ADP ADP ODSH                   | EUR                   | 1.509.065                       |
| 9  | ACCENTURE ACCENTURE ODSH       | EUR                   | 1.508.975                       |
| 10 | INTUIT INTUIT ODSH             | EUR                   | 1.508.921                       |

### Euroland Value

| #  | Emittenten von Sicherheiten      | Währung des Teilfonds | Betrag in Währung des Teilfonds |
|----|----------------------------------|-----------------------|---------------------------------|
| 1  | NVIDIA NVIDIA ODSH               | EUR                   | 6.187.139                       |
| 2  | ACCENTURE ACCENTURE ODSH         | EUR                   | 5.349.286                       |
| 3  | SALESFORCE SALESFORCE ODSH       | EUR                   | 5.349.216                       |
| 4  | EATON CORP EATON CORP ODSH       | EUR                   | 5.349.167                       |
| 5  | COMCAST COMCAST ODSH             | EUR                   | 5.349.055                       |
| 6  | MICROSOFT MICROSOFT ODSH         | EUR                   | 5.349.040                       |
| 7  | INTUIT INTUIT ODSH               | EUR                   | 3.567.470                       |
| 8  | Regierung von Japan              | EUR                   | 2.477.074                       |
| 9  | UK-Regierung                     | EUR                   | 1.933.126                       |
| 10 | NATIONAL GRID NATIONAL GRID ODSH | EUR                   | 839.943                         |

### Europe Value

| #  | Emittenten von Sicherheiten    | Währung des Teilfonds | Betrag in Währung des Teilfonds |
|----|--------------------------------|-----------------------|---------------------------------|
| 1  | NVIDIA NVIDIA ODSH             | EUR                   | 1.985.500                       |
| 2  | MICROSOFT MICROSOFT ODSH       | EUR                   | 1.771.177                       |
| 3  | INTUIT INTUIT ODSH             | EUR                   | 986.926                         |
| 4  | EATON CORP EATON CORP ODSH     | EUR                   | 986.867                         |
| 5  | ACCENTURE ACCENTURE ODSH       | EUR                   | 986.832                         |
| 6  | ADP ADP ODSH                   | EUR                   | 986.652                         |
| 7  | PROSUS PROSUS ODSH             | EUR                   | 786.951                         |
| 8  | ASML HOLDING ASML HOLDING ODSH | EUR                   | 786.389                         |
| 9  | ASTRAZENECA ORD USD0.25        | EUR                   | 785.297                         |
| 10 | HERMES INTL HERMES INTL ODSH   | EUR                   | 784.853                         |

# Anhang VII (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte („SFT-Verordnung“) (Fortsetzung)

## Angaben zur Konzentration (Fortsetzung)

Die zehn größten Emittenten für unbare Sicherheiten im Rahmen von Wertpapierleihgeschäften (Fortsetzung)

### Global Emerging Markets Equity

| #  | Emittenten von Sicherheiten            | Währung des Teilfonds | Betrag in Währung des Teilfonds |
|----|--|-----------------------|---------------------------------|
| 1  | HERMES INTL HERMES INTL ODSH           | USD                   | 2.581.805                       |
| 2  | RELX PLC RELX PLC GBP0.1444            | USD                   | 1.200.425                       |
| 3  | TENARIS TENARIS ODSH                   | USD                   | 1.164.178                       |
| 4  | TENCENT HOLDINGS TENCENT HOLDINGS ODSH | USD                   | 1.161.838                       |
| 5  | UNILEVER PLC ORD SHARES OF 3 1/9 PENCE | USD                   | 1.161.833                       |
| 6  | ALIBABA ALIBABA ODSH                   | USD                   | 1.142.740                       |
| 7  | TESCO TESCO ODSH                       | USD                   | 332.103                         |
| 8  | NETEASE NETEASE ODSH                   | USD                   | 191.583                         |
| 9  | NINTENDO NINTENDO ODSH                 | USD                   | 163.877                         |
| 10 | CCB CCB ODSH                           | USD                   | 672                             |

### Global Infrastructure Equity

| # | Emittenten von Sicherheiten | Währung des Teilfonds | Betrag in Währung des Teilfonds |
|---|-----------------------------|-----------------------|---------------------------------|
| 1 | Regierung von Japan         | USD                   | 36.626.012                      |
| 2 | US-Regierung                | USD                   | 17.051.606                      |
| 3 | UK-Regierung                | USD                   | 9.983.789                       |
| 4 | Regierung von Belgien       | USD                   | 2.506.371                       |
| 5 | Regierung von Österreich    | USD                   | 2.506.371                       |
| 6 | Regierung von Frankreich    | USD                   | 2.506.370                       |
| 7 | Regierung von Finnland      | USD                   | 2.505.932                       |
| 8 | Regierung von Deutschland   | USD                   | 439                             |

### Hong Kong Equity

| # | Emittenten von Sicherheiten | Währung des Teilfonds | Betrag in Währung des Teilfonds |
|---|-----------------------------|-----------------------|---------------------------------|
| 1 | Regierung von Japan         | USD                   | 149.799                         |
| 2 | Regierung von Frankreich    | USD                   | 50.021                          |
| 3 | Regierung von Deutschland   | USD                   | 49.987                          |

### Global Lower Carbon Equity

| #  | Emittenten von Sicherheiten          | Währung des Teilfonds | Betrag in Währung des Teilfonds |
|----|--------------------------------------|-----------------------|---------------------------------|
| 1  | UK-Regierung                         | USD                   | 2.161.225                       |
| 2  | LVMH LVMH ODSH                       | USD                   | 1.639.448                       |
| 3  | COCA COLA COCA COLA ODSH             | USD                   | 1.636.356                       |
| 4  | VODAFONE GROUP VODAFONE GROUP ODSH   | USD                   | 1.636.356                       |
| 5  | TESCO TESCO ODSH                     | USD                   | 1.636.353                       |
| 6  | NATIONAL GRID NATIONAL GRID ODSH     | USD                   | 1.636.350                       |
| 7  | RELX PLC RELX PLC GBP0.1444          | USD                   | 404.822                         |
| 8  | BMO BMO ODSH                         | USD                   | 305.919                         |
| 9  | STMICROELECTRON STMICROELECTRON ODSH | USD                   | 305.364                         |
| 10 | TD TD ODSH                           | USD                   | 304.783                         |

### Global Sustainable Long Term Dividend

| #  | Emittenten von Sicherheiten      | Währung des Teilfonds | Betrag in Währung des Teilfonds |
|----|----------------------------------|-----------------------|---------------------------------|
| 1  | ASTRAZENECA ORD USD0.25          | USD                   | 690.287                         |
| 2  | MICROSOFT MICROSOFT ODSH         | USD                   | 539.430                         |
| 3  | COCA COLA COCA COLA ODSH         | USD                   | 448.745                         |
| 4  | TESCO TESCO ODSH                 | USD                   | 448.745                         |
| 5  | NATIONAL GRID NATIONAL GRID ODSH | USD                   | 448.737                         |
| 6  | INTEL INTEL ODSH                 | USD                   | 447.942                         |
| 7  | APPLIED APPLIED ODSH             | USD                   | 447.824                         |
| 8  | PROSUS PROSUS ODSH               | USD                   | 242.115                         |
| 9  | ASML HOLDING ASML HOLDING ODSH   | USD                   | 241.963                         |
| 10 | HERMES INTL HERMES INTL ODSH     | USD                   | 241.072                         |

### BRIC Equity

| #  | Emittenten von Sicherheiten      | Währung des Teilfonds | Betrag in Währung des Teilfonds |
|----|----------------------------------|-----------------------|---------------------------------|
| 1  | SAFRAN SAFRAN ODSH               | USD                   | 191.571                         |
| 2  | IMPERIAL TOBACCO ORD GBP0.10     | USD                   | 191.400                         |
| 3  | ROLLS ROYCE ROLLS ROYCE ODSH     | USD                   | 191.400                         |
| 4  | NESTLE NESTLE ODSH               | USD                   | 191.349                         |
| 5  | ORACLE ORACLE ODSH               | USD                   | 191.162                         |
| 6  | BROADCOM BROADCOM ODSH           | USD                   | 189.897                         |
| 7  | CISCO SYSTEMS CISCO SYSTEMS ODSH | USD                   | 129.004                         |
| 8  | Regierung von Frankreich         | USD                   | 3.409                           |
| 9  | Regierung von Deutschland        | USD                   | 3.353                           |
| 10 | Regierung von Japan              | USD                   | 3.292                           |

# Anhang VII (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte („SFT-Verordnung“) (Fortsetzung)

## Angaben zur Konzentration (Fortsetzung)

Die zehn größten Emittenten für unbare Sicherheiten im Rahmen von Wertpapierleihgeschäften (Fortsetzung)

### BRIC Markets Equity

| # | Emittenten von Sicherheiten            | Währung des Teilfonds | Betrag in Währung des Teilfonds |
|---|--|-----------------------|---------------------------------|
| 1 | UNILEVER PLC ORD SHARES OF 3 1/9 PENCE | USD                   | 63.525                          |
| 2 | CRODA CRODA ODSH                       | USD                   | 63.513                          |
| 3 | CISCO SYSTEMS CISCO SYSTEMS ODSH       | USD                   | 63.407                          |
| 4 | BROADCOM BROADCOM ODSH                 | USD                   | 63.299                          |
| 5 | MICROSOFT MICROSOFT ODSH               | USD                   | 63.215                          |
| 6 | FLUTTER FLUTTER ODSH                   | USD                   | 54.449                          |
| 7 | GSK GSK ODSH                           | USD                   | 42.951                          |

### Frontier Markets

| # | Emittenten von Sicherheiten        | Währung des Teilfonds | Betrag in Währung des Teilfonds |
|---|------------------------------------|-----------------------|---------------------------------|
| 1 | ACCOR ACCOR ODSH                   | USD                   | 64.839                          |
| 2 | VODAFONE GROUP VODAFONE GROUP ODSH | USD                   | 64.738                          |
| 3 | EXPERIAN GROUP LIMITED ORD USD0,10 | USD                   | 64.712                          |
| 4 | ASTRAZENECA ORD USD0,25            | USD                   | 64.655                          |
| 5 | APPLE APPLE ODSH                   | USD                   | 64.471                          |
| 6 | FLUTTER FLUTTER ODSH               | USD                   | 55.470                          |
| 7 | NATIONAL GRID NATIONAL GRID ODSH   | USD                   | 43.140                          |
| 8 | UK-Regierung                       | USD                   | 466                             |

### Global Equity Volatility Focused

| #  | Emittenten von Sicherheiten        | Währung des Teilfonds | Betrag in Währung des Teilfonds |
|----|------------------------------------|-----------------------|---------------------------------|
| 1  | Regierung von Deutschland          | USD                   | 1.612.112                       |
| 2  | Regierung der Niederlande          | USD                   | 1.612.112                       |
| 3  | Regierung von Frankreich           | USD                   | 1.611.836                       |
| 4  | US-Regierung                       | USD                   | 1.607.657                       |
| 5  | ALTRIA GROUP ALTRIA GROUP ODSH     | USD                   | 1.216.673                       |
| 6  | WEST PHARM SVC WEST PHARM SVC ODSH | USD                   | 405.923                         |
| 7  | Regierung von Japan                | USD                   | 314.634                         |
| 8  | FLUTTER FLUTTER ODSH               | USD                   | 283.473                         |
| 9  | ALLIANZ ALLIANZ ODSH               | USD                   | 220.776                         |
| 10 | GSK GSK ODSH                       | USD                   | 220.340                         |

### Global Real Estate Equity

| #  | Emittenten von Sicherheiten      | Währung des Teilfonds | Betrag in Währung des Teilfonds |
|----|----------------------------------|-----------------------|---------------------------------|
| 1  | Regierung von Japan              | USD                   | 16.830.890                      |
| 2  | Regierung von Frankreich         | USD                   | 8.959.975                       |
| 3  | Regierung von Deutschland        | USD                   | 6.977.835                       |
| 4  | US-Regierung                     | USD                   | 5.923.737                       |
| 5  | BNP BNP ODSH                     | USD                   | 4.965.125                       |
| 6  | SHELL SHELL ODSH                 | USD                   | 4.955.311                       |
| 7  | BP PLC ORD USD0,25               | USD                   | 4.955.306                       |
| 8  | CISCO SYSTEMS CISCO SYSTEMS ODSH | USD                   | 4.949.328                       |
| 9  | JP MORGAN JP MORGAN ODSH         | USD                   | 4.949.293                       |
| 10 | BROADCOM BROADCOM ODSH           | USD                   | 4.949.194                       |

### Economic Scale US Equity

| #  | Emittenten von Sicherheiten  | Währung des Teilfonds | Betrag in Währung des Teilfonds |
|----|------------------------------|-----------------------|---------------------------------|
| 1  | Regierung von Frankreich     | USD                   | 2.611.202                       |
| 2  | Regierung von Deutschland    | USD                   | 2.611.201                       |
| 3  | Regierung der Niederlande    | USD                   | 2.611.192                       |
| 4  | US-Regierung                 | USD                   | 2.602.863                       |
| 5  | NVIDIA NVIDIA ODSH           | USD                   | 2.010.770                       |
| 6  | SERVICENOW SERVICENOW ODSH   | USD                   | 1.970.364                       |
| 7  | ASTRAZENECA ORD USD0,25      | USD                   | 1.967.494                       |
| 8  | VINCI VINCI ODSH             | USD                   | 1.944.712                       |
| 9  | ALPHABET ALPHABET ODSH       | USD                   | 1.882.201                       |
| 10 | NATWEST GRP NATWEST GRP ODSH | USD                   | 1.322.113                       |

### Indian Equity

| # | Emittenten von Sicherheiten      | Währung des Teilfonds | Betrag in Währung des Teilfonds |
|---|----------------------------------|-----------------------|---------------------------------|
| 1 | ALLIANZ ALLIANZ ODSH             | USD                   | 1.005.555                       |
| 2 | IMPERIAL TOBACCO ORD GBP0,10     | USD                   | 1.003.828                       |
| 3 | COMPASS GROUP COMPASS GROUP ODSH | USD                   | 1.003.823                       |
| 4 | JP MORGAN JP MORGAN ODSH         | USD                   | 1.002.588                       |
| 5 | ORACLE ORACLE ODSH               | USD                   | 1.002.536                       |
| 6 | NVIDIA NVIDIA ODSH               | USD                   | 1.001.775                       |
| 7 | ROCHE HLDG ROCHE HLDG PART       | USD                   | 670.800                         |

### Asia Bond

| #  | Emittenten von Sicherheiten                       | Währung des Teilfonds | Betrag in Währung des Teilfonds |
|----|---|-----------------------|---------------------------------|
| 1  | US-Regierung                                      | USD                   | 24.513.207                      |
| 2  | UK-Regierung                                      | USD                   | 24.355.418                      |
| 3  | Regierung von Japan                               | USD                   | 12.512.114                      |
| 4  | Barmittel auf Konten für Dreiparteiensicherheiten | USD                   | 5.324.266                       |
| 5  | Regierung von Belgien                             | USD                   | 1.768.032                       |
| 6  | BRITISH COLUMBIA BCPRV 2,250 06.02.26             | USD                   | 1.575.541                       |
| 7  | ALBERTA ALBTA 2,200 06.01.25                      | USD                   | 1.529.486                       |
| 8  | ALBERTA ALBTA 0,625 16.01.25 MTN                  | USD                   | 1.394.897                       |
| 9  | Regierung von Österreich                          | USD                   | 1.288.503                       |
| 10 | ALBERTA ALBTA 1,000 20.05.25                      | USD                   | 959.033                         |

### Asia High Yield Bond

| #  | Emittenten von Sicherheiten                       | Währung des Teilfonds | Betrag in Währung des Teilfonds |
|----|---|-----------------------|---------------------------------|
| 1  | UK-Regierung                                      | USD                   | 48.678.637                      |
| 2  | Regierung von Japan                               | USD                   | 33.740.229                      |
| 3  | US-Regierung                                      | USD                   | 14.928.968                      |
| 4  | Barmittel auf Konten für Dreiparteiensicherheiten | USD                   | 7.106.010                       |
| 5  | Regierung von Frankreich                          | USD                   | 6.397.425                       |
| 6  | Regierung von Deutschland                         | USD                   | 5.161.872                       |
| 7  | Regierung von Belgien                             | USD                   | 5.008.795                       |
| 8  | Regierung von Australien                          | USD                   | 3.203.563                       |
| 9  | EU EUUNI 3,375 11.04.42 MTN                       | USD                   | 2.857.198                       |
| 10 | KOMMUNEKREDIT KMUNK 4,625 03.05.27 MTN            | USD                   | 2.846.806                       |

# Anhang VII (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte („SFT-Verordnung“) (Fortsetzung)

## Angaben zur Konzentration (Fortsetzung)

Die zehn größten Emittenten für unbare Sicherheiten im Rahmen von Wertpapierleihgeschäften (Fortsetzung)

### Euro Bond

| # | Emittenten von Sicherheiten | Währung des Teilfonds | Betrag in Währung des Teilfonds |
|---|-----------------------------|-----------------------|---------------------------------|
| 1 | UK-Regierung                | EUR                   | 1.295.260                       |
| 2 | US-Regierung                | EUR                   | 1.233.691                       |
| 3 | Regierung von Japan         | EUR                   | 513.752                         |
| 4 | Regierung von Belgien       | EUR                   | 35.532                          |
| 5 | Regierung der Niederlande   | EUR                   | 6.143                           |
| 6 | Regierung von Deutschland   | EUR                   | 1.171                           |
| 7 | ALPHABET ALPHABET ODSH      | EUR                   | 279                             |
| 8 | Regierung von Frankreich    | EUR                   | 3                               |

### Euro Bond Total Return

| #  | Emittenten von Sicherheiten                     | Währung des Teilfonds | Betrag in Währung des Teilfonds |
|----|---|-----------------------|---------------------------------|
| 1  | Regierung von Japan                             | EUR                   | 4.472.170                       |
| 2  | UK-Regierung                                    | EUR                   | 3.130.469                       |
| 3  | Regierung von Deutschland                       | EUR                   | 1.576.643                       |
| 4  | US-Regierung                                    | EUR                   | 1.483.084                       |
| 5  | ALBERTA ALBTA 0,625 16.01.26 MTN                | EUR                   | 549.544                         |
| 6  | Regierung von Finnland                          | EUR                   | 544.821                         |
| 7  | Barmittel auf Konten für Dreiparteisicherheiten | EUR                   | 494.374                         |
| 8  | Regierung der Niederlande                       | EUR                   | 10.372                          |
| 9  | Regierung von Belgien                           | EUR                   | 7.054                           |
| 10 | ALPHABET ALPHABET ODSH                          | EUR                   | 419                             |

### Euro Credit Bond

| #  | Emittenten von Sicherheiten                     | Währung des Teilfonds | Betrag in Währung des Teilfonds |
|----|---|-----------------------|---------------------------------|
| 1  | UK-Regierung                                    | EUR                   | 23.656.769                      |
| 2  | US-Regierung                                    | EUR                   | 13.958.132                      |
| 3  | Regierung von Belgien                           | EUR                   | 4.156.086                       |
| 4  | Barmittel auf Konten für Dreiparteisicherheiten | EUR                   | 3.758.049                       |
| 5  | ALBERTA ALBTA 2,200 06.01.26                    | EUR                   | 3.340.420                       |
| 6  | Regierung von Deutschland                       | EUR                   | 2.137.999                       |
| 7  | ALBERTA ALBTA 0,625 16.01.26 MTN                | EUR                   | 1.476.357                       |
| 8  | Regierung von Japan                             | EUR                   | 1.358.666                       |
| 9  | Regierung von Finnland                          | EUR                   | 1.170.530                       |
| 10 | Regierung von Frankreich                        | EUR                   | 1.124.488                       |

### Euro High Yield Bond

| #  | Emittenten von Sicherheiten                     | Währung des Teilfonds | Betrag in Währung des Teilfonds |
|----|---|-----------------------|---------------------------------|
| 1  | US-Regierung                                    | EUR                   | 35.644.145                      |
| 2  | UK-Regierung                                    | EUR                   | 34.748.140                      |
| 3  | Regierung von Frankreich                        | EUR                   | 31.384.899                      |
| 4  | Regierung von Belgien                           | EUR                   | 8.648.674                       |
| 5  | Regierung von Deutschland                       | EUR                   | 7.423.391                       |
| 6  | Regierung von Japan                             | EUR                   | 5.638.793                       |
| 7  | Barmittel auf Konten für Dreiparteisicherheiten | EUR                   | 4.452.349                       |
| 8  | Regierung von Österreich                        | EUR                   | 3.033.879                       |
| 9  | Regierung von Kanada                            | EUR                   | 1.936.843                       |
| 10 | ALBERTA ALBTA 2,200 06.01.26                    | EUR                   | 1.628.751                       |

### GEM Debt Total Return

| # | Emittenten von Sicherheiten          | Währung des Teilfonds | Betrag in Währung des Teilfonds |
|---|--------------------------------------|-----------------------|---------------------------------|
| 1 | US-Regierung                         | USD                   | 727.066                         |
| 2 | UK-Regierung                         | USD                   | 398.027                         |
| 3 | Regierung von Japan                  | USD                   | 264.233                         |
| 4 | ALBERTA ALBTA 0,625 16.01.26 MTN     | USD                   | 198.529                         |
| 5 | Regierung von Belgien                | USD                   | 46.525                          |
| 6 | QUEBEC PROVINCE QUBPR 3,625 04.13.28 | USD                   | 4.923                           |
| 7 | Regierung von Kanada                 | USD                   | 1.036                           |
| 8 | Regierung von Deutschland            | USD                   | 902                             |

### Global Bond Total Return

| #  | Emittenten von Sicherheiten                     | Währung des Teilfonds | Betrag in Währung des Teilfonds |
|----|---|-----------------------|---------------------------------|
| 1  | US-Regierung                                    | EUR                   | 4.398.887                       |
| 2  | Regierung von Japan                             | EUR                   | 3.759.668                       |
| 3  | UK-Regierung                                    | EUR                   | 3.312.859                       |
| 4  | Regierung von Deutschland                       | EUR                   | 1.328.139                       |
| 5  | ALBERTA ALBTA 0,625 16.01.26 MTN                | EUR                   | 797.233                         |
| 6  | Barmittel auf Konten für Dreiparteisicherheiten | EUR                   | 708.011                         |
| 7  | Regierung von Finnland                          | EUR                   | 539.814                         |
| 8  | Regierung von Österreich                        | EUR                   | 497.385                         |
| 9  | Regierung von Belgien                           | EUR                   | 344.544                         |
| 10 | ALBERTA ALBTA 2,200 06.01.26                    | EUR                   | 337.596                         |

### Global Corporate Bond

| #  | Emittenten von Sicherheiten            | Währung des Teilfonds | Betrag in Währung des Teilfonds |
|----|--|-----------------------|---------------------------------|
| 1  | UK-Regierung                           | USD                   | 124.050.902                     |
| 2  | US-Regierung                           | USD                   | 118.398.926                     |
| 3  | Regierung von Frankreich               | USD                   | 77.185.344                      |
| 4  | Regierung von Japan                    | USD                   | 29.413.874                      |
| 5  | Regierung von Belgien                  | USD                   | 24.003.747                      |
| 6  | WILLIS TOWERS WILLIS TOWERS ODSH       | USD                   | 18.257.075                      |
| 7  | AMERICAN EXPRESS AMERICAN EXPRESS ODSH | USD                   | 18.181.510                      |
| 8  | BLACKROCK BLACKROCK ODSH               | USD                   | 18.181.398                      |
| 9  | PROGRESSIVE PROGRESSIVE ODSH           | USD                   | 18.180.987                      |
| 10 | Regierung von Australien               | USD                   | 15.137.168                      |

### Global Emerging Markets Bond

| #  | Emittenten von Sicherheiten                     | Währung des Teilfonds | Betrag in Währung des Teilfonds |
|----|---|-----------------------|---------------------------------|
| 1  | UK-Regierung                                    | USD                   | 41.278.158                      |
| 2  | US-Regierung                                    | USD                   | 37.242.375                      |
| 3  | Regierung von Japan                             | USD                   | 12.130.416                      |
| 4  | Barmittel auf Konten für Dreiparteisicherheiten | USD                   | 6.587.339                       |
| 5  | ALBERTA ALBTA 0,625 16.01.26 MTN                | USD                   | 6.555.602                       |
| 6  | Regierung von Australien                        | USD                   | 4.399.391                       |
| 7  | Regierung von Deutschland                       | USD                   | 3.398.860                       |
| 8  | Regierung von Belgien                           | USD                   | 3.368.172                       |
| 9  | ALBERTA ALBTA 2,200 06.01.26                    | USD                   | 1.888.403                       |
| 10 | EU EUUNI 3,375 11.04.42 MTN                     | USD                   | 1.229.383                       |

# Anhang VII (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte („SFT-Verordnung“) (Fortsetzung)

## Angaben zur Konzentration (Fortsetzung)

Die zehn größten Emittenten für unbare Sicherheiten im Rahmen von Wertpapierleihgeschäften (Fortsetzung)

Global Emerging Markets Local Debt

| #  | Emittenten von Sicherheiten            | Währung des Teilfonds | Betrag in Währung des Teilfonds |
|----|--|-----------------------|---------------------------------|
| 1  | MICROSOFT MICROSOFT ODSH               | USD                   | 17.863.153                      |
| 2  | CITIGROUP CITIGROUP ODSH               | USD                   | 17.324.648                      |
| 3  | GOLDMAN SACHS GOLDMAN SACHS ODSH       | USD                   | 17.324.645                      |
| 4  | WELLS FARGO WELLS FARGO ODSH           | USD                   | 17.324.594                      |
| 5  | AMERICAN EXPRESS AMERICAN EXPRESS ODSH | USD                   | 17.324.487                      |
| 6  | NVIDIA NVIDIA ODSH                     | USD                   | 17.324.390                      |
| 7  | US-Regierung                           | USD                   | 16.307.134                      |
| 8  | UK-Regierung                           | USD                   | 14.554.772                      |
| 9  | Regierung von Japan                    | USD                   | 12.453.876                      |
| 10 | CHEVRON CHEVRON ODSH                   | USD                   | 11.550.356                      |

Global Government Bond

| #  | Emittenten von Sicherheiten | Währung des Teilfonds | Betrag in Währung des Teilfonds |
|----|-----------------------------|-----------------------|---------------------------------|
| 1  | Regierung von Japan         | USD                   | 92.065.497                      |
| 2  | UK-Regierung                | USD                   | 65.962.248                      |
| 3  | ALPHABET ALPHABET ODSH      | USD                   | 46.057.463                      |
| 4  | AMD AMD ODSH                | USD                   | 35.099.608                      |
| 5  | APPLE APPLE ODSH            | USD                   | 35.099.608                      |
| 6  | BERKSHIRE BERKSHIRE ODSH    | USD                   | 35.099.252                      |
| 7  | ADOBE ADOBE ODSH            | USD                   | 35.099.178                      |
| 8  | Regierung von Kanada        | USD                   | 32.570.604                      |
| 9  | NVIDIA NVIDIA ODSH          | USD                   | 21.117.598                      |
| 10 | ENERPLUS ENERPLUS ODSH      | USD                   | 16.712.387                      |

Global High Income Bond

| #  | Emittenten von Sicherheiten        | Währung des Teilfonds | Betrag in Währung des Teilfonds |
|----|------------------------------------|-----------------------|---------------------------------|
| 1  | US-Regierung                       | USD                   | 48.096.069                      |
| 2  | UK-Regierung                       | USD                   | 28.097.791                      |
| 3  | Regierung von Frankreich           | USD                   | 25.062.693                      |
| 4  | Regierung von Japan                | USD                   | 10.536.906                      |
| 5  | JAPAN TOBACCO JAPAN TOBACCO ODSH   | USD                   | 7.339.738                       |
| 6  | RESONAC HLDG RESONAC HLDG ODSH     | USD                   | 7.339.308                       |
| 7  | KIRIN HOLDINGS KIRIN HOLDINGS ODSH | USD                   | 7.339.286                       |
| 8  | KYOWA KIRIN KYOWA KIRIN ODSH       | USD                   | 7.339.119                       |
| 9  | DENTSU GROUP DENTSU GROUP ODSH     | USD                   | 7.338.402                       |
| 10 | SUMCO SUMCO ODSH                   | USD                   | 7.337.017                       |

Global High Yield Bond

| #  | Emittenten von Sicherheiten                     | Währung des Teilfonds | Betrag in Währung des Teilfonds |
|----|---|-----------------------|---------------------------------|
| 1  | UK-Regierung                                    | USD                   | 19.616.564                      |
| 2  | US-Regierung                                    | USD                   | 7.896.037                       |
| 3  | Barmittel auf Konten für Dreiparteisicherheiten | USD                   | 11.318.877                      |
| 4  | Regierung von Frankreich                        | USD                   | 4.527.092                       |
| 5  | Regierung von Belgien                           | USD                   | 3.171.686                       |
| 6  | ALBERTA ALBTA 2,200 06.01.26                    | USD                   | 2.707.161                       |
| 7  | BRITISH COLUMBIA BCPRV 2,750 18.06.52           | USD                   | 2.706.905                       |
| 8  | Regierung von Deutschland                       | USD                   | 1.228.468                       |
| 9  | MICROSOFT MICROSOFT ODSH                        | USD                   | 1.394.388                       |
| 10 | Regierung der Niederlande                       | USD                   | 789.752                         |

Global Inflation Linked Bond

| #  | Emittenten von Sicherheiten          | Währung des Teilfonds | Betrag in Währung des Teilfonds |
|----|--------------------------------------|-----------------------|---------------------------------|
| 1  | NVIDIA NVIDIA ODSH                   | USD                   | 10.477.123                      |
| 2  | ALIBABA ALIBABA ODSH                 | USD                   | 10.415.628                      |
| 3  | ICBC ICBC ODSH                       | USD                   | 10.415.626                      |
| 4  | FAST RETAILING FAST RETAILING ODSH   | USD                   | 10.411.402                      |
| 5  | MICROSOFT MICROSOFT ODSH             | USD                   | 10.403.000                      |
| 6  | KROGER KROGER ODSH                   | USD                   | 5.588.547                       |
| 7  | ELECTRONIC ARTS ELECTRONIC ARTS ODSH | USD                   | 5.503.858                       |
| 8  | BLACKROCK BLACKROCK ODSH             | USD                   | 4.967.294                       |
| 9  | PROGRESSIVE PROGRESSIVE ODSH         | USD                   | 4.908.432                       |
| 10 | S&P GLOBAL S&P GLOBAL ODSH           | USD                   | 4.882.187                       |

Global Short Duration Bond

| #  | Emittenten von Sicherheiten | Währung des Teilfonds | Betrag in Währung des Teilfonds |
|----|-----------------------------|-----------------------|---------------------------------|
| 1  | Regierung von Japan         | USD                   | 96.650.589                      |
| 2  | US-Regierung                | USD                   | 49.783.204                      |
| 3  | UK-Regierung                | USD                   | 29.168.642                      |
| 4  | ENEL ENEL ODSH              | USD                   | 10.978.175                      |
| 5  | LVMH LVMH ODSH              | USD                   | 10.977.721                      |
| 6  | INFORMA INFORMA ODSH        | USD                   | 10.956.416                      |
| 7  | NVIDIA NVIDIA ODSH          | USD                   | 10.942.813                      |
| 8  | LILLY LILLY ODSH            | USD                   | 10.942.767                      |
| 9  | Regierung von Finnland      | USD                   | 6.584.744,2                     |
| 10 | Regierung von Australien    | USD                   | 6.470.804                       |

US Short Duration High Yield Bond\*

| # | Emittenten von Sicherheiten                     | Währung des Teilfonds | Betrag in Währung des Teilfonds |
|---|---|-----------------------|---------------------------------|
| 1 | US-Regierung                                    | USD                   | 6.848.019                       |
| 2 | UK-Regierung                                    | USD                   | 6.065.189                       |
| 3 | Barmittel auf Konten für Dreiparteisicherheiten | USD                   | 1.029.824                       |
| 4 | Regierung von Japan                             | USD                   | 244.490                         |
| 5 | Regierung von Deutschland                       | USD                   | 115.871                         |
| 6 | Regierung der Niederlande                       | USD                   | 56.810                          |
| 7 | Regierung von Australien                        | USD                   | 56.422                          |
| 8 | Regierung von Luxemburg                         | USD                   | 1.110                           |
| 9 | Regierung von Belgien                           | USD                   | 989                             |

RMB Fixed Income

| # | Emittenten von Sicherheiten                     | Währung des Teilfonds | Betrag in Währung des Teilfonds |
|---|---|-----------------------|---------------------------------|
| 1 | US-Regierung                                    | USD                   | 896.735                         |
| 2 | UK-Regierung                                    | USD                   | 860.987                         |
| 3 | Barmittel auf Konten für Dreiparteisicherheiten | USD                   | 743.516                         |
| 4 | Regierung von Japan                             | USD                   | 448.029                         |
| 5 | ALBERTA ALBTA 0,625 16.01.26 MTN                | USD                   | 198.529                         |
| 6 | Regierung von Belgien                           | USD                   | 2.616                           |
| 7 | Regierung von Deutschland                       | USD                   | 2.253                           |
| 8 | Regierung von Luxemburg                         | USD                   | 1.110                           |
| 9 | Regierung von Frankreich                        | USD                   | 207                             |

\* Bis zum 3. Juli 2023 lautete der Name des Teilfonds „Global Short Duration High Yield Bond“.

# Anhang VII (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte („SFT-Verordnung“) (Fortsetzung)

## Angaben zur Konzentration (Fortsetzung)

Die zehn größten Emittenten für unbare Sicherheiten im Rahmen von Wertpapierleihgeschäften (Fortsetzung)

### Singapore Dollar Income Bond

| #  | Emittenten von Sicherheiten                     | Währung des Teilfonds | Betrag in Währung des Teilfonds |
|----|---|-----------------------|---------------------------------|
| 1  | Regierung von Japan                             | USD                   | 9.029.780                       |
| 2  | US-Regierung                                    | USD                   | 7.931.381                       |
| 3  | UK-Regierung                                    | USD                   | 4.403.595                       |
| 4  | Barmittel auf Konten für Dreiparteisicherheiten | USD                   | 3.124.568                       |
| 5  | Regierung von Belgien                           | USD                   | 916.066                         |
| 6  | ALBERTA ALBTA 0,625 16.01.26 MTN                | USD                   | 806.608                         |
| 7  | QUEBEC PROVINCE QUBPR 3,625 04.13.28            | USD                   | 240.507                         |
| 8  | BRITISH COLUMBIA BCPRV 2,250 06.02.26           | USD                   | 19.366                          |
| 9  | Regierung von Luxemburg                         | USD                   | 4.494                           |
| 10 | Regierung von Frankreich                        | USD                   | 59                              |

### US Dollar Bond

| # | Emittenten von Sicherheiten | Währung des Teilfonds | Betrag in Währung des Teilfonds |
|---|-----------------------------|-----------------------|---------------------------------|
| 1 | UK-Regierung                | USD                   | 1.507.551                       |
| 2 | US-Regierung                | USD                   | 8.877.743                       |

### Managed Solutions – Asia Focused Conservative

| # | Emittenten von Sicherheiten | Währung des Teilfonds | Betrag in Währung des Teilfonds |
|---|-----------------------------|-----------------------|---------------------------------|
| 1 | Regierung von Japan         | USD                   | 316.092                         |

### Managed Solutions – Asia Focused Income

| #  | Emittenten von Sicherheiten                     | Währung des Teilfonds | Betrag in Währung des Teilfonds |
|----|---|-----------------------|---------------------------------|
| 1  | Regierung von Japan                             | USD                   | 8.757.416                       |
| 2  | UK-Regierung                                    | USD                   | 1.842.661                       |
| 3  | US-Regierung                                    | USD                   | 1.367.290                       |
| 4  | Barmittel auf Konten für Dreiparteisicherheiten | USD                   | 1.119.489                       |
| 5  | Regierung der Niederlande                       | USD                   | 629.207                         |
| 6  | ALBERTA ALBTA 0,625 16.01.26 MTN                | USD                   | 489.565                         |
| 7  | Regierung von Finnland                          | USD                   | 433.470                         |
| 8  | Regierung von Frankreich                        | USD                   | 339.606                         |
| 9  | RECRUIT HOLDINGS RECRUIT HOLDINGS ODSH          | USD                   | 192.917                         |
| 10 | SHIN-ETSU CHEM SHIN-ETSU CHEM ODSH              | USD                   | 192.248                         |

### US Income Focused

| #  | Emittenten von Sicherheiten                     | Währung des Teilfonds | Betrag in Währung des Teilfonds |
|----|---|-----------------------|---------------------------------|
| 1  | US-Regierung                                    | USD                   | 10.517.399                      |
| 2  | Barmittel auf Konten für Dreiparteisicherheiten | USD                   | 2.977.260                       |
| 3  | Regierung von Japan                             | USD                   | 2.119.237                       |
| 4  | RELX PLC RELX PLC GBP0,1444                     | USD                   | 711.406                         |
| 5  | EXPERIAN GROUP LIMITED ORD USD0,10              | USD                   | 585.528                         |
| 6  | NATIONAL GRID NATIONAL GRID ODSH                | USD                   | 585.525                         |
| 7  | APPLE APPLE ODSH                                | USD                   | 584.575                         |
| 8  | MICROSOFT MICROSOFT ODSH                        | USD                   | 584.523                         |
| 9  | NVIDIA NVIDIA ODSH                              | USD                   | 583.918                         |
| 10 | UK-Regierung                                    | USD                   | 554.616                         |

### Ultra Short Duration Bond Fund

| # | Emittenten von Sicherheiten | Währung des Teilfonds | Betrag in Währung des Teilfonds |
|---|-----------------------------|-----------------------|---------------------------------|
| 1 | Regierung von Japan         | USD                   | 47.089.433                      |

### US High Yield Bond Fund

| # | Emittenten von Sicherheiten                     | Währung des Teilfonds | Betrag in Währung des Teilfonds |
|---|---|-----------------------|---------------------------------|
| 1 | US-Regierung                                    | USD                   | 1.108.024                       |
| 2 | UK-Regierung                                    | USD                   | 746.250                         |
| 3 | Regierung von Japan                             | USD                   | 476.769                         |
| 4 | Barmittel auf Konten für Dreiparteisicherheiten | USD                   | 335.049                         |
| 5 | Regierung von Belgien                           | USD                   | 1.375                           |
| 6 | Regierung von Luxemburg                         | USD                   | 1.110                           |
| 7 | Regierung von Frankreich                        | USD                   | 219                             |

### Multi-Asset Style Factors

| # | Emittenten von Sicherheiten          | Währung des Teilfonds | Betrag in Währung des Teilfonds |
|---|--------------------------------------|-----------------------|---------------------------------|
| 1 | SAP SE SAP SE ODSH                   | USD                   | 11.668.225                      |
| 2 | APPLE APPLE ODSH                     | USD                   | 11.631.028                      |
| 3 | JOHNSON&JOHNSON JOHNSON&JOHNSON ODSH | USD                   | 11.630.976                      |
| 4 | LILLY LILLY ODSH                     | USD                   | 11.630.910                      |
| 5 | MICROSOFT MICROSOFT ODSH             | USD                   | 11.630.689                      |
| 6 | NVIDIA NVIDIA ODSH                   | USD                   | 11.630.552                      |
| 7 | INTESA SANPAOLO INTESA SANPAOLO ODSH | USD                   | 3.924.769                       |
| 8 | AMAZON.COM AMAZON.COM ODSH           | USD                   | 2.031.580                       |
| 9 | ENEL ENEL ODSH                       | USD                   | 1.869.526                       |



# Anhang VII (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte („SFT-Verordnung“) (Fortsetzung)

## Angaben zur Konzentration (Fortsetzung)

Die zehn größten Kontrahenten für unbare Sicherheiten im Rahmen von Wertpapierleihgeschäften

| Asia ex Japan Equity |                       |                       |   |
|----------------------|-----------------------|-----------------------|---|
| #                    | Kontrahenten          | Währung des Teilfonds | Erhaltene unbare Sicherheiten in Teilfondswährung |
| 1                    | Macquarie Bank, Ltd   | USD                   | 5.072.031   |
| 2                    | HSBC Bank PLC, London | USD                   | 1.778.667   |

| Asia Pacific ex Japan Equity High Dividend |              |                       |   |
|--|--------------|-----------------------|---|
| #  | Kontrahenten | Währung des Teilfonds | Erhaltene unbare Sicherheiten in Teilfondswährung |
| 1  | UBS AG       | USD                   | 10.206.897  |

| Euroland Equity Smaller Companies |                        |                       |   |
|-----------------------------------|------------------------|-----------------------|---|
| #                                 | Kontrahenten           | Währung des Teilfonds | Erhaltene unbare Sicherheiten in Teilfondswährung |
| 1                                 | Barclays Bank, London  | EUR                   | 9.688.418   |
| 2                                 | Morgan Stanley, London | EUR                   | 4.498.585   |
| 3                                 | Natixis                | EUR                   | 2.658.547   |

| Euroland Value |                        |                       |   |
|----------------|------------------------|-----------------------|---|
| #              | Kontrahenten           | Währung des Teilfonds | Erhaltene unbare Sicherheiten in Teilfondswährung |
| 1              | Barclays Bank, London  | EUR                   | 35.662.218  |
| 2              | HSBC Bank PLC, London  | EUR                   | 5.587.623   |
| 3              | Morgan Stanley, London | EUR                   | 4.128.432   |

| Global Emerging Markets Equity |                                     |                       |   |
|--------------------------------|-------------------------------------|-----------------------|---|
| #                              | Kontrahenten                        | Währung des Teilfonds | Erhaltene unbare Sicherheiten in Teilfondswährung |
| 1                              | Natixis                             | USD                   | 8.688.772   |
| 2                              | J.P. Morgan Chase Bank, New York    | USD                   | 7.751.634   |
| 3                              | HSBC Bank PLC, London               | USD                   | 2.210.557   |
| 4                              | Goldman Sachs International, London | USD                   | 1.295.152   |
| 5                              | UBS AG                              | USD                   | 1.117.501   |

| Global Infrastructure Equity |  |                       |   |
|------------------------------|--|-----------------------|---|
| #                            | Kontrahenten                             | Währung des Teilfonds | Erhaltene unbare Sicherheiten in Teilfondswährung |
| 1                            | Merrill Lynch International Bank, London | USD                   | 36.626.012  |
| 2                            | Goldman Sachs International, London      | USD                   | 24.534.013  |
| 3                            | Barclays Bank, London                    | USD                   | 12.526.865  |

| Hong Kong Equity |                       |                       |   |
|------------------|-----------------------|-----------------------|---|
| #                | Kontrahenten          | Währung des Teilfonds | Erhaltene unbare Sicherheiten in Teilfondswährung |
| 1                | Barclays Bank, London | USD                   | 249.806   |

| BRIC Markets Equity |              |                       |   |
|---------------------|--------------|-----------------------|---|
| #                   | Kontrahenten | Währung des Teilfonds | Erhaltene unbare Sicherheiten in Teilfondswährung |
| 1                   | Natixis      | USD                   | 414.358   |

| Asia ex Japan Equity Smaller Companies |  |                       |   |
|--|--|-----------------------|---|
| #                                      | Kontrahenten                             | Währung des Teilfonds | Erhaltene unbare Sicherheiten in Teilfondswährung |
| 1                                      | Goldman Sachs International, London      | USD                   | 27.807.243  |
| 2                                      | Barclays Bank, London                    | USD                   | 12.694.422  |
| 3                                      | Merrill Lynch International Bank, London | USD                   | 11.258.939  |
| 4                                      | BNP Paribas                              | USD                   | 3.380.824   |
| 5                                      | Morgan Stanley, London                   | USD                   | 2.603.635   |
| 6                                      | J.P. Morgan Chase Bank, New York         | USD                   | 2.306.778   |
| 7                                      | Macquarie Bank, Ltd                      | USD                   | 1.830.114   |
| 8                                      | UBS AG                                   | USD                   | 1.314.239   |
| 9                                      | HSBC Bank PLC, London                    | USD                   | 1.252.471   |
| 10                                     | Citigroup Global Markets, Ltd            | USD                   | 1.197.656   |

| Chinese Equity |  |                       |   |
|----------------|--|-----------------------|---|
| #              | Kontrahenten                             | Währung des Teilfonds | Erhaltene unbare Sicherheiten in Teilfondswährung |
| 1              | Natixis                                  | USD                   | 4.961.958   |
| 2              | Merrill Lynch International Bank, London | USD                   | 2.805.429   |
| 3              | Hong Kong & Shanghai Bank, Hongkong      | USD                   | 1.405.258   |
| 4              | Barclays Bank, London                    | USD                   | 1.092.473   |
| 5              | HSBC Bank PLC, London                    | USD                   | 465.529   |
| 6              | Mizuho Securities Co., Ltd               | USD                   | 413.732   |
| 7              | J.P. Morgan Chase Bank, New York         | USD                   | 52.315  |

| Euroland Growth |                       |                       |   |
|-----------------|-----------------------|-----------------------|---|
| #               | Kontrahenten          | Währung des Teilfonds | Erhaltene unbare Sicherheiten in Teilfondswährung |
| 1               | Natixis               | EUR                   | 13.175.949  |
| 2               | Barclays Bank, London | EUR                   | 12.114.131  |
| 3               | HSBC Bank PLC, London | EUR                   | 215.497   |

| Europe Value |                                    |                       |   |
|--------------|------------------------------------|-----------------------|---|
| #            | Kontrahenten                       | Währung des Teilfonds | Erhaltene unbare Sicherheiten in Teilfondswährung |
| 1            | Barclays Bank, London              | EUR                   | 6.579.597   |
| 2            | Natixis                            | EUR                   | 5.238.841   |
| 3            | BNP Paribas Arbitrage London/Paris | EUR                   | 1.432.693   |
| 4            | UBS AG                             | EUR                   | 76.221  |

| Global Lower Carbon Equity |                       |                       |   |
|----------------------------|-----------------------|-----------------------|---|
| #                          | Kontrahenten          | Währung des Teilfonds | Erhaltene unbare Sicherheiten in Teilfondswährung |
| 1                          | HSBC Bank PLC, London | USD                   | 10.891.254  |
| 2                          | Bank of Nova Scotia   | USD                   | 2.040.609   |
| 3                          | SMBC NIKKO Securities | USD                   | 1.618.193   |

| Global Sustainable Long Term Dividend |                       |                       |   |
|---------------------------------------|-----------------------|-----------------------|---|
| #                                     | Kontrahenten          | Währung des Teilfonds | Erhaltene unbare Sicherheiten in Teilfondswährung |
| 1                                     | HSBC Bank PLC, London | USD                   | 2.990.192   |
| 2                                     | Natixis               | USD                   | 1.611.967   |

| BRIC Equity |  |                       |   |
|-------------|--|-----------------------|---|
| #           | Kontrahenten                             | Währung des Teilfonds | Erhaltene unbare Sicherheiten in Teilfondswährung |
| 1           | Natixis                                  | USD                   | 1.275.783   |
| 2           | Merrill Lynch International Bank, London | USD                   | 11.981  |
| 3           | Barclays Bank, London                    | USD                   | 5.315   |

| Frontier Markets |                       |                       |   |
|------------------|-----------------------|-----------------------|---|
| #                | Kontrahenten          | Währung des Teilfonds | Erhaltene unbare Sicherheiten in Teilfondswährung |
| 1                | HSBC Bank PLC, London | USD                   | 422.491   |

# Anhang VII (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte („SFT-Verordnung“) (Fortsetzung)

## Angaben zur Konzentration (Fortsetzung)

Die zehn größten Kontrahenten für unbare Sicherheiten im Rahmen von Wertpapierleihgeschäften

### Global Equity Volatility Focused

| # | Kontrahenten                             | Währung des Teilfonds | Erhaltene unbare Sicherheiten in Teilfondswährung |
|---|--|-----------------------|---|
| 1 | Merrill Lynch International Bank, London | USD                   | 8.065.574   |
| 2 | SMBC NIKKO Securities                    | USD                   | 1.579.222   |
| 3 | Natixis                                  | USD                   | 1.438.925   |
| 4 | Citigroup Global Markets, Ltd            | USD                   | 790.058   |
| 5 | HSBC Bank PLC, London                    | USD                   | 719.251   |

### Economic Scale US Equity

| # | Kontrahenten                             | Währung des Teilfonds | Erhaltene unbare Sicherheiten in Teilfondswährung |
|---|--|-----------------------|---|
| 1 | Merrill Lynch International Bank, London | USD                   | 13.064.124  |
| 2 | Skandinaviska                            | USD                   | 8.814.091   |
| 3 | HSBC Bank PLC, London                    | USD                   | 8.457.651   |
| 4 | Bank of Nova Scotia, Houston Branch      | USD                   | 5.081.641   |
| 5 | Natixis                                  | USD                   | 4.305.995   |
| 6 | UBS AG                                   | USD                   | 1.272.715   |
| 7 | BNP Paribas Prime Brokerage              | USD                   | 101.770   |

### Asia Bond

| # | Kontrahenten                             | Währung des Teilfonds | Erhaltene unbare Sicherheiten in Teilfondswährung |
|---|--|-----------------------|---|
| 1 | Goldman Sachs International, London      | USD                   | 18.646.423  |
| 2 | BNP Paribas                              | USD                   | 15.849.376  |
| 3 | Nomura International, Plc                | USD                   | 13.267.614  |
| 4 | Barclays Bank, Plc                       | USD                   | 9.939.082   |
| 5 | Merrill Lynch International Bank, London | USD                   | 9.283.809   |
| 6 | Morgan Stanley, London                   | USD                   | 5.159.518   |
| 7 | Hong Kong & Shanghai Bank, Hongkong      | USD                   | 4.585.836   |
| 8 | Jefferies International, LTD             | USD                   | 1.860.469   |
| 9 | HSBC Bank PLC, London                    | USD                   | 1.830.428   |

### Euro Bond

| # | Kontrahenten                             | Währung des Teilfonds | Erhaltene unbare Sicherheiten in Teilfondswährung |
|---|--|-----------------------|---|
| 1 | Goldman Sachs International, London      | EUR                   | 1.257.938   |
| 2 | Merrill Lynch International Bank, London | EUR                   | 613.683   |
| 3 | Royal Bank of Canada                     | EUR                   | 515.104   |
| 4 | Morgan Stanley, London                   | EUR                   | 502.685   |
| 5 | Nomura International, Plc                | EUR                   | 196.423   |

### Euro Credit Bond

| # | Kontrahenten                             | Währung des Teilfonds | Erhaltene unbare Sicherheiten in Teilfondswährung |
|---|--|-----------------------|---|
| 1 | Barclays Bank, Plc                       | EUR                   | 22.095.984  |
| 2 | Goldman Sachs International, London      | EUR                   | 12.516.826  |
| 3 | Merrill Lynch International Bank, London | EUR                   | 10.448.002  |
| 4 | Banco Santander                          | EUR                   | 5.616.113   |
| 5 | Royal Bank of Canada                     | EUR                   | 4.959.241   |
| 6 | Morgan Stanley, London                   | EUR                   | 1.697.324   |

### GEM Debt Total Return

| # | Kontrahenten                             | Währung des Teilfonds | Erhaltene unbare Sicherheiten in Teilfondswährung |
|---|--|-----------------------|---|
| 1 | Merrill Lynch International Bank, London | USD                   | 1.325.949   |
| 2 | Nomura International, Plc                | USD                   | 315.292   |

### Global Real Estate Equity

| # | Kontrahenten                             | Währung des Teilfonds | Erhaltene unbare Sicherheiten in Teilfondswährung |
|---|--|-----------------------|---|
| 1 | Natixis                                  | USD                   | 33.024.000  |
| 2 | Barclays Bank, London                    | USD                   | 17.886.392  |
| 3 | Merrill Lynch International Bank, London | USD                   | 16.992.415  |
| 4 | Morgan Stanley, London                   | USD                   | 12.726.121  |
| 5 | HSBC Bank PLC, London                    | USD                   | 7.705.891   |
| 6 | Macquarie Bank, Ltd                      | USD                   | 2.438.082   |
| 7 | Bank of Nova Scotia, Houston Branch      | USD                   | 1.733.186   |
| 8 | UBS AG                                   | USD                   | 1.262.623   |

### Indian Equity

| # | Kontrahenten | Währung des Teilfonds | Erhaltene unbare Sicherheiten in Teilfondswährung |
|---|--------------|-----------------------|---|
| 1 | Natixis      | USD                   | 6.690.904   |

### Asia High Yield Bond

| #  | Kontrahenten                             | Währung des Teilfonds | Erhaltene unbare Sicherheiten in Teilfondswährung |
|----|--|-----------------------|---|
| 1  | Hong Kong & Shanghai Bank, Hongkong      | USD                   | 30.950.665  |
| 2  | Merrill Lynch International Bank, London | USD                   | 21.232.823  |
| 3  | Morgan Stanley, London                   | USD                   | 16.872.467  |
| 4  | Deutsche Bank                            | USD                   | 15.140.060  |
| 5  | BNP Paribas                              | USD                   | 14.606.916  |
| 6  | Barclays Bank, Plc                       | USD                   | 14.506.635  |
| 7  | Nomura International, Plc                | USD                   | 9.128.236   |
| 8  | Goldman Sachs International, London      | USD                   | 8.795.867   |
| 9  | J.P. Morgan Chase Bank, New York         | USD                   | 6.479.409   |
| 10 | HSBC Bank PLC, London                    | USD                   | 4.463.102   |

### Euro Bond Total Return

| # | Kontrahenten                             | Währung des Teilfonds | Erhaltene unbare Sicherheiten in Teilfondswährung |
|---|--|-----------------------|---|
| 1 | Merrill Lynch International Bank, London | USD                   | 4.917.069   |
| 2 | BNP Paribas                              | USD                   | 3.661.226   |
| 3 | Barclays Bank, Plc                       | USD                   | 1.210.595   |
| 4 | Morgan Stanley, London                   | USD                   | 1.012.770   |
| 5 | Royal Bank of Canada                     | USD                   | 902.351   |
| 6 | Goldman Sachs International, London      | USD                   | 565.295   |

### Euro High Yield Bond

| #  | Kontrahenten                             | Währung des Teilfonds | Erhaltene unbare Sicherheiten in Teilfondswährung |
|----|--|-----------------------|---|
| 1  | J.P. Morgan Chase Bank, New York         | EUR                   | 38.138.405  |
| 2  | Goldman Sachs International, London      | EUR                   | 28.775.682  |
| 3  | Barclays Bank, Plc                       | EUR                   | 25.147.514  |
| 4  | BNP Paribas                              | EUR                   | 10.104.597  |
| 5  | Merrill Lynch International Bank, London | EUR                   | 9.213.338   |
| 6  | Banco Santander                          | EUR                   | 8.747.798   |
| 7  | Morgan Stanley, London                   | EUR                   | 7.295.672   |
| 8  | HSBC Bank PLC, London                    | EUR                   | 7.266.444   |
| 9  | Royal Bank of Canada                     | EUR                   | 4.241.267   |
| 10 | Deutsche Bank                            | EUR                   | 2.639.308   |

### Global Bond Total Return

| # | Kontrahenten                             | Währung des Teilfonds | Erhaltene unbare Sicherheiten in Teilfondswährung |
|---|--|-----------------------|---|
| 1 | Merrill Lynch International Bank, London | USD                   | 6.634.585   |
| 2 | Goldman Sachs International, London      | USD                   | 2.564.573   |
| 3 | Morgan Stanley, London                   | USD                   | 2.362.732   |
| 4 | BNP Paribas                              | USD                   | 2.242.694   |
| 5 | Barclays Bank, Plc                       | USD                   | 2.219.627   |

# Anhang VII (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte („SFT-Verordnung“) (Fortsetzung)

## Angaben zur Konzentration (Fortsetzung)

Die zehn größten Kontrahenten für unbare Sicherheiten im Rahmen von Wertpapierleihgeschäften

| Global Corporate Bond |  |                       |   |
|-----------------------|--|-----------------------|---|
| #                     | Kontrahenten                             | Währung des Teilfonds | Erhaltene unbare Sicherheiten in Teilfondswährung |
| 1                     | Barclays Bank, Plc                       | USD                   | 156.398.680                                       |
| 2                     | Goldman Sachs International, London      | USD                   | 117.643.958                                       |
| 3                     | J.P. Morgan Chase Bank, New York         | USD                   | 73.905.472  |
| 4                     | Nomura International, Plc                | USD                   | 44.033.014  |
| 5                     | Merrill Lynch International Bank, London | USD                   | 42.494.036  |
| 6                     | HSBC Bank PLC, London                    | USD                   | 38.792.840  |
| 7                     | BNP Paribas                              | USD                   | 36.024.081  |
| 8                     | Deutsche Bank                            | USD                   | 32.036.879  |
| 9                     | Royal Bank of Canada                     | USD                   | 25.632.426  |
| 10                    | Morgan Stanley, London                   | USD                   | 25.286.871  |

| Global Emerging Markets Local Debt |                                     |                       |   |
|------------------------------------|-------------------------------------|-----------------------|---|
| #                                  | Kontrahenten                        | Währung des Teilfonds | Erhaltene unbare Sicherheiten in Teilfondswährung |
| 1                                  | Hong Kong & Shanghai Bank, Hongkong | USD                   | 115.497.686                                       |
| 2                                  | HSBC Bank PLC, London               | USD                   | 26.045.229  |
| 3                                  | Barclays Bank, Plc                  | USD                   | 17.509.638  |
| 4                                  | BNP Paribas                         | USD                   | 12.453.876  |

| Global High Income Bond |  |                       |   |
|-------------------------|--|-----------------------|---|
| #                       | Kontrahenten                             | Währung des Teilfonds | Erhaltene unbare Sicherheiten in Teilfondswährung |
| 1                       | Nomura International, Plc                | USD                   | 56.205.371  |
| 2                       | Goldman Sachs International, London      | USD                   | 47.772.516  |
| 3                       | J.P. Morgan Chase Bank, New York         | USD                   | 29.494.213  |
| 4                       | Merrill Lynch International Bank, London | USD                   | 19.906.959  |
| 5                       | BNP Paribas                              | USD                   | 9.357.255   |
| 6                       | Barclays Bank, Plc                       | USD                   | 5.194.192   |
| 7                       | Banco Santander                          | USD                   | 5.032.795   |
| 8                       | Morgan Stanley, London                   | USD                   | 2.714.830   |
| 9                       | HSBC Bank PLC, London                    | USD                   | 2.509.845   |
| 10                      | Royal Bank of Canada                     | USD                   | 1.204.233   |

| Global Inflation Linked Bond |                                     |                       |   |
|------------------------------|-------------------------------------|-----------------------|---|
| #                            | Kontrahenten                        | Währung des Teilfonds | Erhaltene unbare Sicherheiten in Teilfondswährung |
| 1                            | Hong Kong & Shanghai Bank, Hongkong | USD                   | 69.486.962  |
| 2                            | Barclays Bank, Plc                  | USD                   | 33.221.119  |
| 3                            | HSBC Bank PLC, London               | USD                   | 23.101.736  |
| 4                            | Bank of Nova Scotia                 | USD                   | 1.121.209   |

| US Short Duration High Yield Bond* |                                     |                       |   |
|------------------------------------|-------------------------------------|-----------------------|---|
| #                                  | Kontrahenten                        | Währung des Teilfonds | Erhaltene unbare Sicherheiten in Teilfondswährung |
| 1                                  | Goldman Sachs International, London | USD                   | 12.508.074  |
| 2                                  | Barclays Bank, Plc                  | USD                   | 1.225.758   |
| 3                                  | Royal Bank of Canada                | USD                   | 379.864   |
| 4                                  | Morgan Stanley, London              | USD                   | 305.328   |

| Global Emerging Markets Bond |  |                       |   |
|------------------------------|--|-----------------------|---|
| #                            | Kontrahenten                             | Währung des Teilfonds | Erhaltene unbare Sicherheiten in Teilfondswährung |
| 1                            | Merrill Lynch International Bank, London | USD                   | 46.433.015  |
| 2                            | Goldman Sachs International, London      | USD                   | 18.758.330  |
| 3                            | HSBC Bank PLC, London                    | USD                   | 16.398.047  |
| 4                            | Barclays Bank, Plc                       | USD                   | 12.265.599  |
| 5                            | Nomura International, Plc                | USD                   | 8.978.049   |
| 6                            | BNP Paribas                              | USD                   | 7.146.128   |
| 7                            | Deutsche Bank                            | USD                   | 6.462.992   |
| 8                            | Morgan Stanley, London                   | USD                   | 5.847.382   |
| 9                            | J.P. Morgan Chase Bank, New York         | USD                   | 2.589.330   |
| 10                           | Jefferies International, LTD             | USD                   | 1.727.578   |

| Global Government Bond |                                    |                       |   |
|------------------------|------------------------------------|-----------------------|---|
| #                      | Kontrahenten                       | Währung des Teilfonds | Erhaltene unbare Sicherheiten in Teilfondswährung |
| 1                      | Royal Bank of Canada               | USD                   | 334.247.792                                       |
| 2                      | TD Securities, Inc                 | USD                   | 234.053.967                                       |
| 3                      | Barclays Bank, Plc                 | USD                   | 98.048.618  |
| 4                      | BNP Paribas Arbitrage London/Paris | USD                   | 89.565.469  |
| 5                      | BNP Paribas                        | USD                   | 77.527.067  |
| 6                      | Nomura International, Plc          | USD                   | 71.557.361  |
| 7                      | NBC Global Finance, LTD            | USD                   | 48.527.805  |
| 8                      | Barclays Bank, London              | USD                   | 32.477.733  |
| 9                      | Natixis                            | USD                   | 17.242.112  |
| 10                     | Morgan Stanley, London             | USD                   | 15.294.050  |

| Global High Yield Bond |  |                       |   |
|------------------------|--|-----------------------|---|
| #                      | Kontrahenten                             | Währung des Teilfonds | Erhaltene unbare Sicherheiten in Teilfondswährung |
| 1                      | BNP Paribas                              | USD                   | 9.912.067   |
| 2                      | Goldman Sachs International, London      | USD                   | 32.910.748  |
| 3                      | J.P. Morgan Chase Bank, New York         | USD                   | 9.950.400   |
| 4                      | Merrill Lynch International Bank, London | USD                   | 1.988.926   |
| 5                      | Morgan Stanley, London                   | USD                   | 5.766.385   |
| 6                      | Nomura International, Plc                | USD                   | 55.952.329  |
| 7                      | Royal Bank of Canada                     | USD                   | 3.645.892   |
| 8                      | Jefferies International, LTD             | USD                   | 1.461.110   |
| 9                      | Banco Santander                          | USD                   | 528.929   |
| 10                     | Barclays Bank, Plc                       | USD                   | 17.712.109  |

| Global Short Duration Bond |  |                       |   |
|----------------------------|--|-----------------------|---|
| #                          | Kontrahenten                             | Währung des Teilfonds | Erhaltene unbare Sicherheiten in Teilfondswährung |
| 1                          | Morgan Stanley, London                   | USD                   | 87.187.475  |
| 2                          | BNP Paribas Arbitrage London/Paris       | USD                   | 72.222.465  |
| 3                          | Merrill Lynch International Bank, London | USD                   | 43.824.382  |
| 4                          | Royal Bank of Canada                     | USD                   | 31.150.335  |
| 5                          | Goldman Sachs International, London      | USD                   | 30.807.158  |
| 6                          | BNP Paribas                              | USD                   | 10.868.657  |
| 7                          | Nomura International, Plc                | USD                   | 7.138.399   |

| RMB Fixed Income |  |                       |   |
|------------------|--|-----------------------|---|
| #                | Kontrahenten                             | Währung des Teilfonds | Erhaltene unbare Sicherheiten in Teilfondswährung |
| 1                | Merrill Lynch International Bank, London | USD                   | 1.325.942   |
| 2                | Barclays Bank, Plc                       | USD                   | 885.578   |
| 3                | Morgan Stanley, London                   | USD                   | 560.154   |
| 4                | Goldman Sachs International, London      | USD                   | 382.307   |

\* Bis zum 3. Juli 2023 lautete der Name des Teilfonds „Global Short Duration High Yield Bond“.

# Anhang VII (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte („SFT-Verordnung“) (Fortsetzung)

## Angaben zur Konzentration (Fortsetzung)

Die zehn größten Kontrahenten für unbare Sicherheiten im Rahmen von Wertpapierleihgeschäften

### Singapore Dollar Income Bond

| # | Kontrahenten                             | Währung des Teilfonds | Erhaltene unbare Sicherheiten in Teilfondswährung |
|---|--|-----------------------|---|
| 1 | Goldman Sachs International, London      | SGD                   | 7.549.307   |
| 2 | Merrill Lynch International Bank, London | SGD                   | 6.269.059   |
| 3 | Nomura International, Plc                | SGD                   | 5.155.395   |
| 4 | Barclays Bank, Plc                       | SGD                   | 3.124.568   |
| 5 | Morgan Stanley, London                   | SGD                   | 2.610.113   |
| 6 | BNP Paribas                              | SGD                   | 1.974.865   |

### US Dollar Bond

| # | Kontrahenten                        | Währung des Teilfonds | Erhaltene unbare Sicherheiten in Teilfondswährung |
|---|-------------------------------------|-----------------------|---|
| 1 | Goldman Sachs International, London | USD                   | 10.385.294  |

### Managed Solutions – Asia Focused Conservative

| # | Kontrahenten | Währung des Teilfonds | Erhaltene unbare Sicherheiten in Teilfondswährung |
|---|--------------|-----------------------|---|
| 1 | BNP Paribas  | USD                   | 316.092   |

### Managed Solutions – Asia Focused Income

| #  | Kontrahenten                             | Währung des Teilfonds | Erhaltene unbare Sicherheiten in Teilfondswährung |
|----|--|-----------------------|---|
| 1  | Merrill Lynch International Bank, London | USD                   | 4.133.766   |
| 2  | Nomura International, Plc                | USD                   | 3.418.881   |
| 3  | BNP Paribas                              | USD                   | 3.012.797   |
| 4  | Morgan Stanley, London                   | USD                   | 2.646.795   |
| 5  | Barclays Bank, Plc                       | USD                   | 1.330.145   |
| 6  | UBS AG                                   | USD                   | 1.288.197   |
| 7  | HSBC Bank PLC, London                    | USD                   | 1.034.086   |
| 8  | J.P. Morgan Chase Bank, New York         | USD                   | 879.496   |
| 9  | Goldman Sachs International, London      | USD                   | 201.990   |
| 10 | Barclays Bank, London                    | USD                   | 3.986   |

### Ultra Short Duration Bond

| # | Kontrahenten            | Währung des Teilfonds | Erhaltene unbare Sicherheiten in Teilfondswährung |
|---|-------------------------|-----------------------|---|
| 1 | National Bank Financial | USD                   | 47.089.433  |

### US High Yield Bond

| # | Kontrahenten                             | Währung des Teilfonds | Erhaltene unbare Sicherheiten in Teilfondswährung |
|---|--|-----------------------|---|
| 1 | Goldman Sachs International, London      | USD                   | 1.073.326   |
| 2 | Merrill Lynch International Bank, London | USD                   | 662.799   |
| 3 | Barclays Bank, Plc                       | USD                   | 398.818   |
| 4 | Morgan Stanley, London                   | USD                   | 285.388   |
| 5 | BNP Paribas                              | USD                   | 248.466   |

### Multi-Asset Style Factors

| # | Kontrahenten | Währung des Teilfonds | Erhaltene unbare Sicherheiten in Teilfondswährung |
|---|--------------|-----------------------|---|
| 1 | BNP Paribas  | EUR                   | 77.648.253  |

### US Income Focused

| # | Kontrahenten                        | Währung des Teilfonds | Erhaltene unbare Sicherheiten in Teilfondswährung |
|---|-------------------------------------|-----------------------|---|
| 1 | Goldman Sachs International, London | USD                   | 10.517.399  |
| 2 | HSBC Bank PLC, London               | USD                   | 3.819.407   |
| 3 | Barclays Bank, Plc                  | USD                   | 3.532.845   |
| 4 | Natixis                             | USD                   | 2.140.852   |
| 5 | BNP Paribas                         | USD                   | 2.119.237   |

# Anhang VII (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte („SFT-Verordnung“) (Fortsetzung)

## Angaben zum Gesamtwert der Transaktionen

Die gesamten Transaktionsdaten aller im Rahmen von Wertpapierfinanzierungsgeschäften erhaltenen Sicherheiten zum 31. März 2024 sind nachstehend aufgeführt:

## Wertpapierleihgeschäfte

### Asia ex Japan Equity

| Sicherheitenkontrahent | Land des Kontrahenten  | Abwicklung und Clearing | Sicherheitstyp | Qualität der Sicherheit** | Sicherheitenwährung | Fälligkeitsprofil* | Beträge (in Währung des Teilfonds) |
|------------------------|------------------------|-------------------------|----------------|---------------------------|---------------------|--------------------|------------------------------------|
| HSBC Bank PLC, London  | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Aktien         | N/C                       | EUR                 | N/C                | 358.409                            |
| HSBC Bank PLC, London  | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Aktien         | N/C                       | GBP                 | N/C                | 1.067.357                          |
| HSBC Bank PLC, London  | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr  | 352.901                            |
| Macquarie Bank, Ltd    | Australien             | Dreiparteisicherheit    | Aktien         | N/C                       | EUR                 | N/C                | 762.056                            |
| Macquarie Bank, Ltd    | Australien             | Dreiparteisicherheit    | Aktien         | N/C                       | CAD                 | N/C                | 1.521.111                          |
| Macquarie Bank, Ltd    | Australien             | Dreiparteisicherheit    | Aktien         | N/C                       | HKD                 | N/C                | 2.788.864                          |

### Asia ex Japan Equity Smaller Companies

| Sicherheitenkontrahent                   | Land des Kontrahenten  | Abwicklung und Clearing | Sicherheitstyp | Qualität der Sicherheit** | Sicherheitenwährung | Fälligkeitsprofil*   | Beträge (in Währung des Teilfonds) |
|--|------------------------|-------------------------|----------------|---------------------------|---------------------|----------------------|------------------------------------|
| HSBC Bank PLC, London                    | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Aktien         | N/C                       | EUR                 | N/C                  | 253.174                            |
| HSBC Bank PLC, London                    | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Aktien         | N/C                       | GBP                 | N/C                  | 363.217                            |
| HSBC Bank PLC, London                    | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Aktien         | N/C                       | USD                 | N/C                  | 187.536                            |
| HSBC Bank PLC, London                    | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 248.544                            |
| Macquarie Bank, Ltd                      | Australien             | Dreiparteisicherheit    | Aktien         | N/C                       | EUR                 | N/C                  | 274.971                            |
| Macquarie Bank, Ltd                      | Australien             | Dreiparteisicherheit    | Aktien         | N/C                       | CAD                 | N/C                  | 548.812                            |
| Macquarie Bank, Ltd                      | Australien             | Dreiparteisicherheit    | Aktien         | N/C                       | HKD                 | N/C                  | 1.006.331                          |
| Mizuho Securities Co., Ltd               | Japan                  | Dreiparteisicherheit    | Aktien         | N/C                       | JPY                 | N/C                  | 217.058                            |
| Mizuho Securities Co., Ltd               | Japan                  | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | A+                        | JPY                 | Mehr als ein Jahr    | 196.724                            |
| UBS AG                                   | Schweiz                | Dreiparteisicherheit    | Aktien         | N/C                       | GBP                 | N/C                  | 198.623                            |
| UBS AG                                   | Schweiz                | Dreiparteisicherheit    | Aktien         | N/C                       | USD                 | N/C                  | 527.832                            |
| UBS AG                                   | Schweiz                | Dreiparteisicherheit    | Aktien         | N/C                       | AUD                 | N/C                  | 4.008                              |
| UBS AG                                   | Schweiz                | Dreiparteisicherheit    | Aktien         | N/C                       | HKD                 | N/C                  | 585.777                            |
| J.P. Morgan Chase Bank, New York         | USA                    | Dreiparteisicherheit    | Aktien         | N/C                       | EUR                 | N/C                  | 697.669                            |
| J.P. Morgan Chase Bank, New York         | USA                    | Dreiparteisicherheit    | Aktien         | N/C                       | GBP                 | N/C                  | 345.776                            |
| J.P. Morgan Chase Bank, New York         | USA                    | Dreiparteisicherheit    | Aktien         | N/C                       | HKD                 | N/C                  | 1.263.328                          |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | A+                        | JPY                 | Mehr als ein Jahr    | 11.258.939                         |
| Goldman Sachs International, London      | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 23.570.055                         |
| Goldman Sachs International, London      | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | AAA                       | USD                 | Weniger als ein Jahr | 4.237.188                          |
| BNP Paribas                              | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Aktien         | N/C                       | EUR                 | N/C                  | 1.018.459                          |
| BNP Paribas                              | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Aktien         | N/C                       | GBP                 | N/C                  | 508.247                            |
| BNP Paribas                              | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Aktien         | N/C                       | USD                 | N/C                  | 1.014.576                          |
| BNP Paribas                              | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 302.817                            |
| BNP Paribas                              | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | A+                        | JPY                 | Mehr als ein Jahr    | 536.723                            |
| Barclays Bank, London                    | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 410                                |
| Barclays Bank, London                    | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 5.079.791                          |
| Barclays Bank, London                    | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 2.534.840                          |
| Barclays Bank, London                    | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | AA+                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 5.079.381                          |
| Barclays Bank, London                    | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Aktien         | N/C                       | AUD                 | N/C                  | 2.303                              |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 518.747                            |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 214                                |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 519.349                            |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | AA+                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 313.376                            |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | A+                        | JPY                 | Mehr als ein Jahr    | 1.249.645                          |
| Citigroup Global Markets, Ltd            | USA                    | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | A+                        | JPY                 | Mehr als ein Jahr    | 814.676                            |
| Citigroup Global Markets, Ltd            | USA                    | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | A+                        | JPY                 | Weniger als ein Jahr | 382.960                            |

### Asia Pacific ex Japan Equity High Dividend

| Sicherheitenkontrahent | Land des Kontrahenten | Abwicklung und Clearing | Sicherheitstyp | Qualität der Sicherheit** | Sicherheitenwährung | Fälligkeitsprofil* | Beträge (in Währung des Teilfonds) |
|------------------------|-----------------------|-------------------------|----------------|---------------------------|---------------------|--------------------|------------------------------------|
| UBS AG                 | Schweiz               | Dreiparteisicherheit    | Aktien         | N/C                       | JPY                 | N/C                | 10.206.897                         |

### Chinese Equity

| Sicherheitenkontrahent                   | Land des Kontrahenten  | Abwicklung und Clearing | Sicherheitstyp | Qualität der Sicherheit** | Sicherheitenwährung | Fälligkeitsprofil*   | Beträge (in Währung des Teilfonds) |
|--|------------------------|-------------------------|----------------|---------------------------|---------------------|----------------------|------------------------------------|
| Hong Kong & Shanghai Bank, Hongkong      | China                  | Dreiparteisicherheit    | Aktien         | N/C                       | USD                 | N/C                  | 631.224                            |
| Hong Kong & Shanghai Bank, Hongkong      | China                  | Dreiparteisicherheit    | Aktien         | N/C                       | JPY                 | N/C                  | 185.368                            |
| Hong Kong & Shanghai Bank, Hongkong      | China                  | Dreiparteisicherheit    | Aktien         | N/C                       | AUD                 | N/C                  | 210.899                            |
| Hong Kong & Shanghai Bank, Hongkong      | China                  | Dreiparteisicherheit    | Aktien         | N/C                       | HKD                 | N/C                  | 377.768                            |
| HSBC Bank PLC, London                    | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Aktien         | N/C                       | EUR                 | N/C                  | 69.399                             |
| HSBC Bank PLC, London                    | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Aktien         | N/C                       | GBP                 | N/C                  | 164.696                            |
| HSBC Bank PLC, London                    | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Aktien         | N/C                       | USD                 | N/C                  | 139.028                            |
| HSBC Bank PLC, London                    | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 92.406                             |
| Mizuho Securities Co., Ltd               | Japan                  | Dreiparteisicherheit    | Aktien         | N/C                       | JPY                 | N/C                  | 221.912                            |
| Mizuho Securities Co., Ltd               | Japan                  | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | A+                        | JPY                 | Mehr als ein Jahr    | 191.828                            |
| J.P. Morgan Chase Bank, New York         | USA                    | Dreiparteisicherheit    | Aktien         | N/C                       | EUR                 | N/C                  | 20.999                             |
| J.P. Morgan Chase Bank, New York         | USA                    | Dreiparteisicherheit    | Aktien         | N/C                       | GBP                 | N/C                  | 7.819                              |
| J.P. Morgan Chase Bank, New York         | USA                    | Dreiparteisicherheit    | Aktien         | N/C                       | HKD                 | N/C                  | 23.501                             |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | A+                        | JPY                 | Mehr als ein Jahr    | 2.805.429                          |
| Barclays Bank, London                    | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 159.599                            |
| Barclays Bank, London                    | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 27.776                             |
| Barclays Bank, London                    | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 58.953                             |
| Barclays Bank, London                    | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | AA+                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 118.069                            |
| Barclays Bank, London                    | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | A+                        | JPY                 | Mehr als ein Jahr    | 350.762                            |
| Barclays Bank, London                    | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | A+                        | JPY                 | Weniger als ein Jahr | 127.317                            |
| Natixis                                  | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Aktien         | N/C                       | EUR                 | N/C                  | 2.234.644                          |
| Natixis                                  | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Aktien         | N/C                       | GBP                 | N/C                  | 1.241.576                          |
| Natixis                                  | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Aktien         | N/C                       | USD                 | N/C                  | 1.485.739                          |

\* Die Kontrakte für die Wertpapierleihgeschäfte haben eine offene Laufzeit

\*\* S&P Long-term Issuer Rating

# Anhang VII (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte („SFT-Verordnung“) (Fortsetzung)

## Aggregierte Transaktionsdaten (Fortsetzung)

### Wertpapierleihgeschäfte (Fortsetzung)

#### Euroland Equity Smaller Companies

| Sicherheitenkontrahent | Land des Kontrahenten  | Abwicklung und Clearing | Sicherheitstyp | Qualität der Sicherheit** | Sicherheitenwährung | Fälligkeitsprofil* | Beträge (in Währung des Teilfonds) |
|------------------------|------------------------|-------------------------|----------------|---------------------------|---------------------|--------------------|------------------------------------|
| Barclays Bank, London  | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Aktien         | N/C                       | USD                 | N/C                | 9.688.418                          |
| Morgan Stanley, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Aktien         | N/C                       | AUD                 | N/C                | 5.843                              |
| Morgan Stanley, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe  | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr  | 898.511                            |
| Morgan Stanley, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe  | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr  | 716.438                            |
| Morgan Stanley, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe  | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr  | 719.623                            |
| Morgan Stanley, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe  | A+                        | JPY                 | Mehr als ein Jahr  | 2.158.366                          |
| Natixis                | Frankreich             | Dreiparteisicherheiten  | Aktien         | N/C                       | EUR                 | N/C                | 1.196.376                          |
| Natixis                | Frankreich             | Dreiparteisicherheiten  | Aktien         | N/C                       | GBP                 | N/C                | 666.385                            |
| Natixis                | Frankreich             | Dreiparteisicherheiten  | Aktien         | N/C                       | USD                 | N/C                | 795.785                            |

#### Euroland Growth

| Sicherheitenkontrahent | Land des Kontrahenten  | Abwicklung und Clearing | Sicherheitstyp | Qualität der Sicherheit** | Sicherheitenwährung | Fälligkeitsprofil* | Beträge (in Währung des Teilfonds) |
|------------------------|------------------------|-------------------------|----------------|---------------------------|---------------------|--------------------|------------------------------------|
| HSBC Bank PLC, London  | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Aktien         | N/C                       | EUR                 | N/C                | 32.444                             |
| HSBC Bank PLC, London  | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Aktien         | N/C                       | GBP                 | N/C                | 54.287                             |
| HSBC Bank PLC, London  | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Aktien         | N/C                       | USD                 | N/C                | 85.986                             |
| HSBC Bank PLC, London  | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe  | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr  | 42.781                             |
| Barclays Bank, London  | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Aktien         | N/C                       | USD                 | N/C                | 10.061.533                         |
| Barclays Bank, London  | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe  | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr  | 131                                |
| Barclays Bank, London  | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe  | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr  | 821.365                            |
| Barclays Bank, London  | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe  | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr  | 409.865                            |
| Barclays Bank, London  | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe  | A+                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr  | 821.234                            |
| Natixis                | Frankreich             | Dreiparteisicherheiten  | Aktien         | N/C                       | EUR                 | N/C                | 5.935.556                          |
| Natixis                | Frankreich             | Dreiparteisicherheiten  | Aktien         | N/C                       | GBP                 | N/C                | 3.295.344                          |
| Natixis                | Frankreich             | Dreiparteisicherheiten  | Aktien         | N/C                       | USD                 | N/C                | 3.945.047                          |

#### Euroland Value

| Sicherheitenkontrahent | Land des Kontrahenten  | Abwicklung und Clearing | Sicherheitstyp | Qualität der Sicherheit** | Sicherheitenwährung | Fälligkeitsprofil*   | Beträge (in Währung des Teilfonds) |
|------------------------|------------------------|-------------------------|----------------|---------------------------|---------------------|----------------------|------------------------------------|
| HSBC Bank PLC, London  | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Aktien         | N/C                       | EUR                 | N/C                  | 564.976                            |
| HSBC Bank PLC, London  | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Aktien         | N/C                       | GBP                 | N/C                  | 1.767.794                          |
| HSBC Bank PLC, London  | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Aktien         | N/C                       | USD                 | N/C                  | 2.145.489                          |
| HSBC Bank PLC, London  | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe  | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 1.109.364                          |
| Barclays Bank, London  | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Aktien         | N/C                       | USD                 | N/C                  | 35.662.218                         |
| Morgan Stanley, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Aktien         | N/C                       | AUD                 | N/C                  | 4.213                              |
| Morgan Stanley, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe  | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 823.259                            |
| Morgan Stanley, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe  | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 123                                |
| Morgan Stanley, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe  | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 823.762                            |
| Morgan Stanley, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe  | A+                        | JPY                 | Mehr als ein Jahr    | 1.321.085                          |
| Morgan Stanley, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe  | A+                        | JPY                 | Weniger als ein Jahr | 1.155.989                          |

#### Europe Value

| Sicherheitenkontrahent | Land des Kontrahenten  | Abwicklung und Clearing | Sicherheitstyp | Qualität der Sicherheit** | Sicherheitenwährung | Fälligkeitsprofil* | Beträge (in Währung des Teilfonds) |
|------------------------|------------------------|-------------------------|----------------|---------------------------|---------------------|--------------------|------------------------------------|
| UBS AG                 | Schweiz                | Dreiparteisicherheiten  | Aktien         | N/C                       | JPY                 | N/C                | 78.221                             |
| BNP Paribas            | Frankreich             | Dreiparteisicherheiten  | Aktien         | N/C                       | EUR                 | N/C                | 431.060                            |
| BNP Paribas            | Frankreich             | Dreiparteisicherheiten  | Aktien         | N/C                       | GBP                 | N/C                | 215.382                            |
| BNP Paribas            | Frankreich             | Dreiparteisicherheiten  | Aktien         | N/C                       | USD                 | N/C                | 429.482                            |
| BNP Paribas            | Frankreich             | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe  | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr  | 129.292                            |
| BNP Paribas            | Frankreich             | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe  | A+                        | JPY                 | Mehr als ein Jahr  | 227.477                            |
| Barclays Bank, London  | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Aktien         | N/C                       | USD                 | N/C                | 6.579.597                          |
| Natixis                | Frankreich             | Dreiparteisicherheiten  | Aktien         | N/C                       | EUR                 | N/C                | 2.358.194                          |
| Natixis                | Frankreich             | Dreiparteisicherheiten  | Aktien         | N/C                       | GBP                 | N/C                | 1.312.482                          |
| Natixis                | Frankreich             | Dreiparteisicherheiten  | Aktien         | N/C                       | USD                 | N/C                | 1.568.168                          |

#### Global Emerging Markets Equity

| Sicherheitenkontrahent              | Land des Kontrahenten  | Abwicklung und Clearing | Sicherheitstyp | Qualität der Sicherheit** | Sicherheitenwährung | Fälligkeitsprofil* | Beträge (in Währung des Teilfonds) |
|-------------------------------------|------------------------|-------------------------|----------------|---------------------------|---------------------|--------------------|------------------------------------|
| HSBC Bank PLC, London               | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Aktien         | N/C                       | EUR                 | N/C                | 446.632                            |
| HSBC Bank PLC, London               | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Aktien         | N/C                       | GBP                 | N/C                | 894.038                            |
| HSBC Bank PLC, London               | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Aktien         | N/C                       | USD                 | N/C                | 331.218                            |
| HSBC Bank PLC, London               | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe  | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr  | 438.669                            |
| UBS AG                              | Schweiz                | Dreiparteisicherheiten  | Aktien         | N/C                       | JPY                 | N/C                | 1.117.501                          |
| J.P. Morgan Chase Bank, New York    | USA                    | Dreiparteisicherheiten  | Aktien         | N/C                       | EUR                 | N/C                | 2.912.132                          |
| J.P. Morgan Chase Bank, New York    | USA                    | Dreiparteisicherheiten  | Aktien         | N/C                       | GBP                 | N/C                | 1.161.833                          |
| J.P. Morgan Chase Bank, New York    | USA                    | Dreiparteisicherheiten  | Aktien         | N/C                       | CAD                 | N/C                | 13.395                             |
| J.P. Morgan Chase Bank, New York    | USA                    | Dreiparteisicherheiten  | Aktien         | N/C                       | CHF                 | N/C                | 1.164.549                          |
| J.P. Morgan Chase Bank, New York    | USA                    | Dreiparteisicherheiten  | Aktien         | N/C                       | HKD                 | N/C                | 2.499.725                          |
| Goldman Sachs International, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe  | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr  | 567.856                            |
| Goldman Sachs International, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe  | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr  | 727.295                            |
| Natixis                             | Frankreich             | Dreiparteisicherheiten  | Aktien         | N/C                       | EUR                 | N/C                | 3.914.094                          |
| Natixis                             | Frankreich             | Dreiparteisicherheiten  | Aktien         | N/C                       | GBP                 | N/C                | 2.173.221                          |
| Natixis                             | Frankreich             | Dreiparteisicherheiten  | Aktien         | N/C                       | USD                 | N/C                | 2.601.457                          |

\* Die Kontrakte für die Wertpapierleihgeschäfte haben eine offene Laufzeit

\*\* S&P Long-term Issuer Rating

# Anhang VII (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte („SFT-Verordnung“) (Fortsetzung)

## Aggregierte Transaktionsdaten (Fortsetzung)

### Wertpapierleihgeschäfte (Fortsetzung)

#### Global Infrastructure Equity

| Sicherheitenkontrahent                   | Land des Kontrahenten  | Abwicklung und Clearing | Sicherheitstyp | Qualität der Sicherheit** | Sicherheitenwährung | Fälligkeitsprofil* | Beträge (in Währung des Teilfonds) |
|--|------------------------|-------------------------|----------------|---------------------------|---------------------|--------------------|------------------------------------|
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe  | A+                        | JPY                 | Mehr als ein Jahr  | 36.626.012                         |
| Goldman Sachs International, London      | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe  | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr  | 17.051.606                         |
| Goldman Sachs International, London      | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe  | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr  | 7.482.408                          |
| Barclays Bank, London                    | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe  | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr  | 439                                |
| Barclays Bank, London                    | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe  | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr  | 5.012.741                          |
| Barclays Bank, London                    | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe  | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr  | 2.501.382                          |
| Barclays Bank, London                    | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe  | AA+                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr  | 5.012.303                          |

#### Global Sustainable Long Term Dividend

| Sicherheitenkontrahent | Land des Kontrahenten  | Abwicklung und Clearing | Sicherheitstyp | Qualität der Sicherheit** | Sicherheitenwährung | Fälligkeitsprofil* | Beträge (in Währung des Teilfonds) |
|------------------------|------------------------|-------------------------|----------------|---------------------------|---------------------|--------------------|------------------------------------|
| HSBC Bank PLC, London  | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Aktien         | N/C                       | GBP                 | N/C                | 1.794.873                          |
| HSBC Bank PLC, London  | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Aktien         | N/C                       | USD                 | N/C                | 1.194.139                          |
| HSBC Bank PLC, London  | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe  | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr  | 1.180                              |
| Natixis                | Frankreich             | Dreiparteisicherheiten  | Aktien         | N/C                       | EUR                 | N/C                | 725.150                            |
| Natixis                | Frankreich             | Dreiparteisicherheiten  | Aktien         | N/C                       | GBP                 | N/C                | 404.792                            |
| Natixis                | Frankreich             | Dreiparteisicherheiten  | Aktien         | N/C                       | USD                 | N/C                | 482.025                            |

#### Global Lower Carbon Equity

| Sicherheitenkontrahent    | Land des Kontrahenten  | Abwicklung und Clearing | Sicherheitstyp | Qualität der Sicherheit** | Sicherheitenwährung | Fälligkeitsprofil* | Beträge (in Währung des Teilfonds) |
|---------------------------|------------------------|-------------------------|----------------|---------------------------|---------------------|--------------------|------------------------------------|
| Bank of Nova Scotia       | Kanada                 | Dreiparteisicherheiten  | Aktien         | N/C                       | EUR                 | N/C                | 305.364                            |
| Bank of Nova Scotia       | Kanada                 | Dreiparteisicherheiten  | Aktien         | N/C                       | GBP                 | N/C                | 815.207                            |
| Bank of Nova Scotia       | Kanada                 | Dreiparteisicherheiten  | Aktien         | N/C                       | CAD                 | N/C                | 920.039                            |
| HSBC Bank PLC, London     | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Aktien         | N/C                       | EUR                 | N/C                | 1.639.448                          |
| HSBC Bank PLC, London     | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Aktien         | N/C                       | GBP                 | N/C                | 6.950.238                          |
| HSBC Bank PLC, London     | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Aktien         | N/C                       | USD                 | N/C                | 92.591                             |
| HSBC Bank PLC, London     | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe  | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr  | 47.638                             |
| HSBC Bank PLC, London     | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe  | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr  | 2.161.229                          |
| HSBC Bank PLC, London     | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe  | AA+                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr  | 113                                |
| SMBC Nikko Securities Inc | Japan                  | Dreiparteisicherheiten  | Aktien         | N/C                       | JPY                 | N/C                | 1.618.193                          |

#### Hong Kong Equity

| Sicherheitenkontrahent | Land des Kontrahenten  | Abwicklung und Clearing | Sicherheitstyp | Qualität der Sicherheit** | Sicherheitenwährung | Fälligkeitsprofil* | Beträge (in Währung des Teilfonds) |
|------------------------|------------------------|-------------------------|----------------|---------------------------|---------------------|--------------------|------------------------------------|
| Barclays Bank, London  | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe  | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr  | 49.987                             |
| Barclays Bank, London  | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe  | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr  | 50.021                             |
| Barclays Bank, London  | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe  | A+                        | JPY                 | Mehr als ein Jahr  | 149.799                            |

#### BRIC Equity

| Sicherheitenkontrahent                   | Land des Kontrahenten  | Abwicklung und Clearing | Sicherheitstyp | Qualität der Sicherheit** | Sicherheitenwährung | Fälligkeitsprofil*   | Beträge (in Währung des Teilfonds) |
|--|------------------------|-------------------------|----------------|---------------------------|---------------------|----------------------|------------------------------------|
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Aktien         | N/C                       | USD                 | N/C                  | 2.473                              |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe  | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 4.789                              |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe  | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 2.374                              |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe  | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 2.345                              |
| Barclays Bank, London                    | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe  | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 959                                |
| Barclays Bank, London                    | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe  | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 1.064                              |
| Barclays Bank, London                    | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe  | A+                        | JPY                 | Mehr als ein Jahr    | 2.630                              |
| Barclays Bank, London                    | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe  | A+                        | JPY                 | Weniger als ein Jahr | 661                                |
| Natixis                                  | Frankreich             | Dreiparteisicherheiten  | Aktien         | N/C                       | EUR                 | N/C                  | 191.571                            |
| Natixis                                  | Frankreich             | Dreiparteisicherheiten  | Aktien         | N/C                       | GBP                 | N/C                  | 382.800                            |
| Natixis                                  | Frankreich             | Dreiparteisicherheiten  | Aktien         | N/C                       | USD                 | N/C                  | 510.063                            |
| Natixis                                  | Frankreich             | Dreiparteisicherheiten  | Aktien         | N/C                       | CHF                 | N/C                  | 191.349                            |

#### BRIC Markets Equity

| Sicherheitenkontrahent | Land des Kontrahenten | Abwicklung und Clearing | Sicherheitstyp | Qualität der Sicherheit** | Sicherheitenwährung | Fälligkeitsprofil* | Beträge (in Währung des Teilfonds) |
|------------------------|-----------------------|-------------------------|----------------|---------------------------|---------------------|--------------------|------------------------------------|
| Natixis                | Frankreich            | Dreiparteisicherheiten  | Aktien         | N/C                       | EUR                 | N/C                | 54.449                             |
| Natixis                | Frankreich            | Dreiparteisicherheiten  | Aktien         | N/C                       | GBP                 | N/C                | 169.989                            |
| Natixis                | Frankreich            | Dreiparteisicherheiten  | Aktien         | N/C                       | USD                 | N/C                | 189.821                            |

#### Frontier Markets

| Sicherheitenkontrahent | Land des Kontrahenten  | Abwicklung und Clearing | Sicherheitstyp | Qualität der Sicherheit** | Sicherheitenwährung | Fälligkeitsprofil* | Beträge (in Währung des Teilfonds) |
|------------------------|------------------------|-------------------------|----------------|---------------------------|---------------------|--------------------|------------------------------------|
| HSBC Bank PLC, London  | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Aktien         | N/C                       | EUR                 | N/C                | 120.308                            |
| HSBC Bank PLC, London  | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Aktien         | N/C                       | GBP                 | N/C                | 237.245                            |
| HSBC Bank PLC, London  | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Aktien         | N/C                       | USD                 | N/C                | 64.471                             |
| HSBC Bank PLC, London  | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe  | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr  | 468                                |

\* Die Kontrakte für die Wertpapierleihgeschäfte haben eine offene Laufzeit

\*\* S&P Long-term Issuer Rating

# Anhang VII (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte („SFT-Verordnung“) (Fortsetzung)

## Aggregierte Transaktionsdaten (Fortsetzung)

### Wertpapierleihgeschäfte (Fortsetzung)

| Global Equity Volatility Focused         |                        |                         |                 |                           |                     |                      |                                    |
|--|------------------------|-------------------------|-----------------|---------------------------|---------------------|----------------------|------------------------------------|
| Sicherheitenkontrahent                   | Land des Kontrahenten  | Abwicklung und Clearing | Sicherheitentyp | Qualität der Sicherheit** | Sicherheitenwährung | Fälligkeitsprofil*   | Beträge (in Währung des Teilfonds) |
| HSC Bank PLC, London                     | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Aktien          | N/C                       | EUR                 | N/C                  | 388.619                            |
| HSC Bank PLC, London                     | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Aktien          | N/C                       | GBP                 | N/C                  | 110.125                            |
| HSC Bank PLC, London                     | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Aktien          | N/C                       | USD                 | N/C                  | 219.768                            |
| HSC Bank PLC, London                     | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 739                                |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Aktien          | N/C                       | USD                 | N/C                  | 1.622.596                          |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 3.224.225                          |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 1.606.917                          |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 1.611.836                          |
| Natixis                                  | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Aktien          | N/C                       | EUR                 | N/C                  | 775.203                            |
| Natixis                                  | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Aktien          | N/C                       | GBP                 | N/C                  | 440.640                            |
| Natixis                                  | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Aktien          | N/C                       | USD                 | N/C                  | 220.076                            |
| Citigroup Global Markets, Ltd            | USA                    | Dreiparteisicherheit    | Aktien          | N/C                       | GBP                 | N/C                  | 118.999                            |
| Citigroup Global Markets, Ltd            | USA                    | Dreiparteisicherheit    | Aktien          | N/C                       | USD                 | N/C                  | 356.425                            |
| Citigroup Global Markets, Ltd            | USA                    | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe   | A+                        | JPY                 | Mehr als ein Jahr    | 63.419                             |
| Citigroup Global Markets, Ltd            | USA                    | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe   | A+                        | JPY                 | Weniger als ein Jahr | 251.221                            |
| SMBC Nikko Securities Inc                | Japan                  | Dreiparteisicherheit    | Aktien          | N/C                       | JPY                 | N/C                  | 1.579.222                          |

| Global Real Estate Equity                |                        |                         |                 |                           |                     |                      |                                    |
|--|------------------------|-------------------------|-----------------|---------------------------|---------------------|----------------------|------------------------------------|
| Sicherheitenkontrahent                   | Land des Kontrahenten  | Abwicklung und Clearing | Sicherheitentyp | Qualität der Sicherheit** | Sicherheitenwährung | Fälligkeitsprofil*   | Beträge (in Währung des Teilfonds) |
| HSC Bank PLC, London                     | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Aktien          | N/C                       | EUR                 | N/C                  | 2.196.993                          |
| HSC Bank PLC, London                     | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Aktien          | N/C                       | GBP                 | N/C                  | 2.361.814                          |
| HSC Bank PLC, London                     | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Aktien          | N/C                       | USD                 | N/C                  | 3.143.430                          |
| HSC Bank PLC, London                     | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 3.654                              |
| Macquarie Bank, Ltd                      | Australien             | Dreiparteisicherheit    | Aktien          | N/C                       | HKD                 | N/C                  | 2.438.082                          |
| UBS AG                                   | Schweiz                | Dreiparteisicherheit    | Aktien          | N/C                       | EUR                 | N/C                  | 124.787                            |
| UBS AG                                   | Schweiz                | Dreiparteisicherheit    | Aktien          | N/C                       | USD                 | N/C                  | 189.061                            |
| UBS AG                                   | Schweiz                | Dreiparteisicherheit    | Aktien          | N/C                       | HKD                 | N/C                  | 948.774                            |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Aktien          | N/C                       | USD                 | N/C                  | 3.418.076                          |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 6.792.744                          |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 3.395.527                          |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 3.396.067                          |
| Barclays Bank, London                    | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 3.581.463                          |
| Barclays Bank, London                    | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 3.581.556                          |
| Barclays Bank, London                    | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe   | A+                        | JPY                 | Mehr als ein Jahr    | 7.863.864                          |
| Barclays Bank, London                    | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe   | A+                        | JPY                 | Weniger als ein Jahr | 2.859.509                          |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Aktien          | N/C                       | GBP                 | N/C                  | 62.097                             |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 2.538.210                          |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 1.982.353                          |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 2.035.944                          |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe   | A+                        | JPY                 | Mehr als ein Jahr    | 6.107.517                          |
| Natixis                                  | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Aktien          | N/C                       | EUR                 | N/C                  | 4.965.125                          |
| Natixis                                  | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Aktien          | N/C                       | GBP                 | N/C                  | 9.910.617                          |
| Natixis                                  | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Aktien          | N/C                       | USD                 | N/C                  | 18.148.257                         |
| Bank of Nova Scotia, Houston Branch      | Kanada                 | Dreiparteisicherheit    | Aktien          | N/C                       | USD                 | N/C                  | 1.733.186                          |

| Economic Scale US Equity                 |                        |                         |                 |                           |                     |                    |                                    |
|--|------------------------|-------------------------|-----------------|---------------------------|---------------------|--------------------|------------------------------------|
| Sicherheitenkontrahent                   | Land des Kontrahenten  | Abwicklung und Clearing | Sicherheitentyp | Qualität der Sicherheit** | Sicherheitenwährung | Fälligkeitsprofil* | Beträge (in Währung des Teilfonds) |
| HSC Bank PLC, London                     | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Aktien          | N/C                       | EUR                 | N/C                | 3.709.065                          |
| HSC Bank PLC, London                     | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Aktien          | N/C                       | GBP                 | N/C                | 2.890.944                          |
| HSC Bank PLC, London                     | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Aktien          | N/C                       | USD                 | N/C                | 2.151.979                          |
| HSC Bank PLC, London                     | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr  | 6.663                              |
| UBS AG                                   | Schweiz                | Dreiparteisicherheit    | Aktien          | N/C                       | JPY                 | N/C                | 1.272.715                          |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Aktien          | N/C                       | USD                 | N/C                | 2.827.665                          |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr  | 5.222.393                          |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr  | 2.602.863                          |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr  | 2.611.202                          |
| Natixis                                  | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Aktien          | N/C                       | EUR                 | N/C                | 1.293.597                          |
| Natixis                                  | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Aktien          | N/C                       | GBP                 | N/C                | 1.936.584                          |
| Natixis                                  | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Aktien          | N/C                       | USD                 | N/C                | 430.294                            |
| Natixis                                  | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Aktien          | N/C                       | CHF                 | N/C                | 645.519                            |
| Standinviska                             | Schweden               | Dreiparteisicherheit    | Aktien          | N/C                       | GBP                 | N/C                | 8.814.091                          |
| Bank of Nova Scotia, Houston Branch      | Kanada                 | Dreiparteisicherheit    | Aktien          | N/C                       | USD                 | N/C                | 5.081.641                          |
| BNP Paribas Prime Brokerage              | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Aktien          | N/C                       | USD                 | N/C                | 101.770                            |

| Indian Equity          |                       |                         |                 |                           |                     |                    |                                    |
|------------------------|-----------------------|-------------------------|-----------------|---------------------------|---------------------|--------------------|------------------------------------|
| Sicherheitenkontrahent | Land des Kontrahenten | Abwicklung und Clearing | Sicherheitentyp | Qualität der Sicherheit** | Sicherheitenwährung | Fälligkeitsprofil* | Beträge (in Währung des Teilfonds) |
| Natixis                | Frankreich            | Dreiparteisicherheit    | Aktien          | N/C                       | EUR                 | N/C                | 1.005.555                          |
| Natixis                | Frankreich            | Dreiparteisicherheit    | Aktien          | N/C                       | GBP                 | N/C                | 2.007.651                          |
| Natixis                | Frankreich            | Dreiparteisicherheit    | Aktien          | N/C                       | USD                 | N/C                | 3.006.899                          |
| Natixis                | Frankreich            | Dreiparteisicherheit    | Aktien          | N/C                       | CHF                 | N/C                | 670.800                            |

\* Die Kontrakte für die Wertpapierleihgeschäfte haben eine offene Laufzeit

\*\* S&P Long-term Issuer Rating



# Anhang VII (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte („SFT-Verordnung“) (Fortsetzung)

## Aggregierte Transaktionsdaten (Fortsetzung)

### Wertpapierleihgeschäfte (Fortsetzung)

#### Asia Bond

| Sicherheitenkontrahent                   | Land des Kontrahenten  | Abwicklung und Clearing | Sicherheitstyp                                  | Qualität der Sicherheit** | Sicherheitenwährung | Fälligkeitsprofil*   | Beträge (in Währung des Teilfonds) |
|--|------------------------|-------------------------|---|---------------------------|---------------------|----------------------|------------------------------------|
| Barclays Bank Plc                        | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 23.530                             |
| Barclays Bank Plc                        | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 3.061.801                          |
| Barclays Bank Plc                        | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Anleihe   | AAA                       | CAD                 | Mehr als ein Jahr    | 1.529.486                          |
| Barclays Bank Plc                        | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Barmittel, die vom Kontrahenten gehalten werden | N/C                       | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 5.324.266                          |
| Hong Kong & Shanghai Bank, Hongkong      | China                  | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Weniger als ein Jahr | 644.849                            |
| Hong Kong & Shanghai Bank, Hongkong      | China                  | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 2.064.830                          |
| Hong Kong & Shanghai Bank, Hongkong      | China                  | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Weniger als ein Jahr | 688.277                            |
| Hong Kong & Shanghai Bank, Hongkong      | China                  | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Weniger als ein Jahr | 1.187.880                          |
| HSBC Bank PLC, London                    | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Aktien  | N/C                       | EUR                 | N/C                  | 102.790                            |
| HSBC Bank PLC, London                    | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Aktien  | N/C                       | USD                 | N/C                  | 348.163                            |
| HSBC Bank PLC, London                    | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 1.087.520                          |
| HSBC Bank PLC, London                    | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Weniger als ein Jahr | 17.521                             |
| HSBC Bank PLC, London                    | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 274.452                            |
| Nomura International, Plc                | Japan                  | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 695.412                            |
| Nomura International, Plc                | Japan                  | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 1.548.569                          |
| Nomura International, Plc                | Japan                  | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 1.052.170                          |
| Nomura International, Plc                | Japan                  | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA+                       | EUR                 | Weniger als ein Jahr | 1.288.503                          |
| Nomura International, Plc                | Japan                  | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Mehr als ein Jahr    | 8.017.544                          |
| Nomura International, Plc                | Japan                  | Dreiparteisicherheit    | Anleihe   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 665.416                            |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 1.602                              |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 2.183.800                          |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | AUD                 | Mehr als ein Jahr    | 2.815                              |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 69.314                             |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 2.394.413                          |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA+                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 888.177                            |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Anleihe   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 1.394.897                          |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Anleihe   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 2.348.991                          |
| Goldman Sachs International, London      | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 18.646.423                         |
| BNP Paribas                              | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 15.045.922                         |
| BNP Paribas                              | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | JPY                 | Mehr als ein Jahr    | 2.713                              |
| BNP Paribas                              | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Anleihe   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 752.073                            |
| BNP Paribas                              | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Anleihe   | AAA                       | CAD                 | Mehr als ein Jahr    | 48.668                             |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 1.029.393                          |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 426                                |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 825.724                            |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Mehr als ein Jahr    | 1.653.069                          |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Weniger als ein Jahr | 1.650.887                          |
| Jefferies International Limited          | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 3.900                              |
| Jefferies International Limited          | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Anleihe   | AA+                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 1.856.569                          |

#### Asia High Yield Bond

| Sicherheitenkontrahent                   | Land des Kontrahenten  | Abwicklung und Clearing | Sicherheitstyp                                  | Qualität der Sicherheit** | Sicherheitenwährung | Fälligkeitsprofil*   | Beträge (in Währung des Teilfonds) |
|--|------------------------|-------------------------|---|---------------------------|---------------------|----------------------|------------------------------------|
| Barclays Bank Plc                        | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 6.785                              |
| Barclays Bank Plc                        | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 704.594                            |
| Barclays Bank Plc                        | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 821                                |
| Barclays Bank Plc                        | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 4.460.294                          |
| Barclays Bank Plc                        | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Anleihe   | AAA                       | CAD                 | Mehr als ein Jahr    | 2.228.131                          |
| Barclays Bank Plc                        | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Barmittel, die vom Kontrahenten gehalten werden | N/C                       | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 7.106.010                          |
| Hong Kong & Shanghai Bank, Hongkong      | China                  | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Weniger als ein Jahr | 4.647.512                          |
| Hong Kong & Shanghai Bank, Hongkong      | China                  | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 18.457.887                         |
| Hong Kong & Shanghai Bank, Hongkong      | China                  | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Weniger als ein Jahr | 4.643.288                          |
| Hong Kong & Shanghai Bank, Hongkong      | China                  | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Weniger als ein Jahr | 3.201.976                          |
| HSBC Bank PLC, London                    | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Aktien  | N/C                       | EUR                 | N/C                  | 466.624                            |
| HSBC Bank PLC, London                    | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Aktien  | N/C                       | USD                 | N/C                  | 665.600                            |
| HSBC Bank PLC, London                    | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 2.663.386                          |
| HSBC Bank PLC, London                    | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 1                                  |
| HSBC Bank PLC, London                    | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 667.492                            |
| Nomura International, Plc                | Japan                  | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Mehr als ein Jahr    | 9.128.236                          |
| J.P. Morgan Chase Bank, New York         | USA                    | Bilaterale Sicherheit   | Staatsanleihe                                   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | -                                  |
| J.P. Morgan Chase Bank, New York         | USA                    | Bilaterale Sicherheit   | Staatsanleihe                                   | AAA                       | NOK                 | Mehr als ein Jahr    | -                                  |
| J.P. Morgan Chase Bank, New York         | USA                    | Bilaterale Sicherheit   | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 6.479.409                          |
| J.P. Morgan Chase Bank, New York         | USA                    | Bilaterale Sicherheit   | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Weniger als ein Jahr | -                                  |
| J.P. Morgan Chase Bank, New York         | USA                    | Bilaterale Sicherheit   | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | -                                  |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 222.310                            |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 4.638.669                          |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | AUD                 | Mehr als ein Jahr    | 3.203.563                          |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 206.652                            |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 10.250.578                         |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Anleihe   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 2.691.050                          |
| Goldman Sachs International, London      | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 9.918                              |
| Goldman Sachs International, London      | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | EUR                 | Weniger als ein Jahr | 106                                |
| Goldman Sachs International, London      | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 6.896.653                          |
| Goldman Sachs International, London      | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 71.808                             |
| Goldman Sachs International, London      | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Weniger als ein Jahr | 17                                 |
| Goldman Sachs International, London      | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 1.439.056                          |
| Goldman Sachs International, London      | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Weniger als ein Jahr | 79                                 |
| Goldman Sachs International, London      | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Mehr als ein Jahr    | 374.925                            |
| Goldman Sachs International, London      | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Weniger als ein Jahr | 3.368                              |
| BNP Paribas                              | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | CAD                 | Mehr als ein Jahr    | 1.464.056                          |
| BNP Paribas                              | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 8.759.964                          |
| BNP Paribas                              | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Mehr als ein Jahr    | 2.164.638                          |
| BNP Paribas                              | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Weniger als ein Jahr | 1.994.679                          |
| BNP Paribas                              | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Anleihe   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 210.370                            |
| BNP Paribas                              | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Anleihe   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 4.897                              |
| BNP Paribas                              | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Anleihe   | AAA                       | CAD                 | Mehr als ein Jahr    | 8.303                              |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Mehr als ein Jahr    | 11.206.575                         |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Weniger als ein Jahr | 5.565.893                          |
| Deutsche Bank                            | Deutschland            | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 5.151.201                          |
| Deutsche Bank                            | Deutschland            | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | CHF                 | Mehr als ein Jahr    | 5.667                              |
| Deutsche Bank                            | Deutschland            | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA+                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 703.147                            |
| Deutsche Bank                            | Deutschland            | Dreiparteisicherheit    | Anleihe   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 6.283                              |
| Deutsche Bank                            | Deutschland            | Dreiparteisicherheit    | Anleihe   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 2.846.806                          |
| Deutsche Bank                            | Deutschland            | Dreiparteisicherheit    | Anleihe   | AA                        | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 2.691.997                          |
| Deutsche Bank                            | Deutschland            | Dreiparteisicherheit    | Anleihe   | AA+                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 2.671.958                          |
| Deutsche Bank                            | Deutschland            | Dreiparteisicherheit    | Medium Term Note                                | N/C                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 863.001                            |

\* Die Kontrakte für die Wertpapierleihgeschäfte haben eine offene Laufzeit

\*\* S&P Long-term Issuer Rating

# Anhang VII (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte („SFT-Verordnung“) (Fortsetzung)

## Aggregierte Transaktionsdaten (Fortsetzung)

### Wertpapierleihgeschäfte (Fortsetzung)

#### Euro Bond

| Sicherheitenkontrahent                   | Land des Kontrahenten  | Abwicklung und Clearing | Sicherheitstyp | Qualität der Sicherheit** | Sicherheitenwährung | Fälligkeitsprofil*   | Beträge (in Währung des Teilfonds) |
|--|------------------------|-------------------------|----------------|---------------------------|---------------------|----------------------|------------------------------------|
| Nomura International, P/c                | Japan                  | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 34.613                             |
| Nomura International, P/c                | Japan                  | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 51.120                             |
| Nomura International, P/c                | Japan                  | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | A+                        | JPY                 | Mehr als ein Jahr    | 110.689                            |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 1.171                              |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 369.551                            |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 919                                |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 242.042                            |
| Goldman Sachs International, London      | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 764.522                            |
| Goldman Sachs International, London      | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 493.417                            |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 99.619                             |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 3                                  |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | A+                        | JPY                 | Mehr als ein Jahr    | 321.645                            |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | A+                        | JPY                 | Weniger als ein Jahr | 81.416                             |
| Royal Bank of Canada                     | Kanada                 | Dreiparteisicherheit    | Aktien         | N/C                       | USD                 | N/C                  | 279                                |
| Royal Bank of Canada                     | Kanada                 | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 6.143                              |
| Royal Bank of Canada                     | Kanada                 | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 508.681                            |

#### Euro Bond Total Return

| Sicherheitenkontrahent                   | Land des Kontrahenten  | Abwicklung und Clearing | Sicherheitstyp                                  | Qualität der Sicherheit** | Sicherheitenwährung | Fälligkeitsprofil*   | Beträge (in Währung des Teilfonds) |
|--|------------------------|-------------------------|---|---------------------------|---------------------|----------------------|------------------------------------|
| Barclays Bank, P/c                       | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 346.175                            |
| Barclays Bank, P/c                       | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 184.722                            |
| Barclays Bank, P/c                       | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 185.324                            |
| Barclays Bank, P/c                       | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Barmittel, die vom Kontrahenten gehalten werden | N/C                       | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 494.374                            |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 1.230.468                          |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 924.929                            |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 7.054                              |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 1.660.253                          |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | A+                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 542.773                            |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA+                       | EUR                 | Weniger als ein Jahr | 2.047                              |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Anleihe   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 549.544                            |
| Goldman Sachs International, London      | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 171.607                            |
| Goldman Sachs International, London      | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 393.688                            |
| BNP Paribas                              | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Mehr als ein Jahr    | 1.904.611                          |
| BNP Paribas                              | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Weniger als ein Jahr | 1.756.614                          |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 201.825                            |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Mehr als ein Jahr    | 486.035                            |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Weniger als ein Jahr | 324.910                            |
| Royal Bank of Canada                     | Kanada                 | Dreiparteisicherheit    | Aktien  | N/C                       | USD                 | N/C                  | 419                                |
| Royal Bank of Canada                     | Kanada                 | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 10.372                             |
| Royal Bank of Canada                     | Kanada                 | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | AUD                 | Mehr als ein Jahr    | 355                                |
| Royal Bank of Canada                     | Kanada                 | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 891.204                            |

#### Euro Credit Bond

| Sicherheitenkontrahent                   | Land des Kontrahenten  | Abwicklung und Clearing | Sicherheitstyp                                  | Qualität der Sicherheit** | Sicherheitenwährung | Fälligkeitsprofil*   | Beträge (in Währung des Teilfonds) |
|--|------------------------|-------------------------|---|---------------------------|---------------------|----------------------|------------------------------------|
| Barclays Bank, P/c                       | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 920.837                            |
| Barclays Bank, P/c                       | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 265.013                            |
| Barclays Bank, P/c                       | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Weniger als ein Jahr | 2.703.492                          |
| Barclays Bank, P/c                       | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 11.108.172                         |
| Barclays Bank, P/c                       | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Anleihe   | AAA                       | CAD                 | Mehr als ein Jahr    | 3.340.420                          |
| Barclays Bank, P/c                       | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Barmittel, die vom Kontrahenten gehalten werden | N/C                       | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 3.758.049                          |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 1.230.468                          |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 1.891.237                          |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 63.192                             |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 4.616.217                          |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | A+                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 1.170.530                          |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Anleihe   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 1.476.357                          |
| Goldman Sachs International, London      | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 8.700.614                          |
| Goldman Sachs International, London      | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Weniger als ein Jahr | 1.906.976                          |
| Goldman Sachs International, London      | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 1.809.237                          |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 338.558                            |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 100                                |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Mehr als ein Jahr    | 1.358.360                          |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Weniger als ein Jahr | 306                                |
| Royal Bank of Canada                     | Kanada                 | Dreiparteisicherheit    | Aktien  | N/C                       | USD                 | N/C                  | 2.096                              |
| Royal Bank of Canada                     | Kanada                 | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 55.797                             |
| Royal Bank of Canada                     | Kanada                 | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | EUR                 | Weniger als ein Jahr | 1                                  |
| Royal Bank of Canada                     | Kanada                 | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | AUD                 | Mehr als ein Jahr    | 355                                |
| Royal Bank of Canada                     | Kanada                 | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 4.900.992                          |
| Banco Santander                          | Spanien                | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 51                                 |
| Banco Santander                          | Spanien                | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 1.120.747                          |
| Banco Santander                          | Spanien                | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 2.248.777                          |
| Banco Santander                          | Spanien                | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 1.122.159                          |
| Banco Santander                          | Spanien                | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA+                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 1.124.388                          |

\* Die Kontrakte für die Wertpapierleihgeschäfte haben eine offene Laufzeit

\*\* S&P Long-term Issuer Rating

# Anhang VII (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte („SFT-Verordnung“) (Fortsetzung)

## Aggregierte Transaktionsdaten (Fortsetzung)

### Wertpapierleihgeschäfte (Fortsetzung)

#### Euro High Yield Bond

| Sicherheitenkontrahent                   | Land des Kontrahenten  | Abwicklung und Clearing | Sicherheitstyp                                  | Qualität der Sicherheit** | Sicherheitenwährung | Fälligkeitsprofil*   | Beträge (in Währung des Teilfonds) |
|--|------------------------|-------------------------|---|---------------------------|---------------------|----------------------|------------------------------------|
| Bank of Nova Scotia                      | Kanada                 | Dreiparteiensicherheit  | Staatsanleihe                                   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 176.253                            |
| Bank of Nova Scotia                      | Kanada                 | Dreiparteiensicherheit  | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 176.754                            |
| Bank of Nova Scotia                      | Kanada                 | Dreiparteiensicherheit  | Staatsanleihe                                   | AAA                       | CAD                 | Weniger als ein Jahr | 662                                |
| Bank of Nova Scotia                      | Kanada                 | Dreiparteiensicherheit  | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 181.623                            |
| Bank of Nova Scotia                      | Kanada                 | Dreiparteiensicherheit  | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 174.706                            |
| Bank of Nova Scotia                      | Kanada                 | Dreiparteiensicherheit  | Staatsanleihe                                   | AA+                       | EUR                 | Weniger als ein Jahr | 2.956                              |
| Bank of Nova Scotia                      | Kanada                 | Dreiparteiensicherheit  | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Mehr als ein Jahr    | 172.683                            |
| Barclays Bank Plc                        | Vereinigtes Königreich | Dreiparteiensicherheit  | Staatsanleihe                                   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 3.901.709                          |
| Barclays Bank Plc                        | Vereinigtes Königreich | Dreiparteiensicherheit  | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 3.776.666                          |
| Barclays Bank Plc                        | Vereinigtes Königreich | Dreiparteiensicherheit  | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 11.388.039                         |
| Barclays Bank Plc                        | Vereinigtes Königreich | Dreiparteiensicherheit  | Anleihe   | AAA                       | CAD                 | Mehr als ein Jahr    | 1.628.751                          |
| Barclays Bank Plc                        | Vereinigtes Königreich | Dreiparteiensicherheit  | Barmittel, die vom Kontrahenten gehalten werden | N/C                       | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 4.452.349                          |
| HSBC Bank PLC, London                    | Vereinigtes Königreich | Dreiparteiensicherheit  | Aktien  | N/C                       | EUR                 | N/C                  | 805.329                            |
| HSBC Bank PLC, London                    | Vereinigtes Königreich | Dreiparteiensicherheit  | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | N/C                  | 1.881.636                          |
| HSBC Bank PLC, London                    | Vereinigtes Königreich | Dreiparteiensicherheit  | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 3.662.996                          |
| HSBC Bank PLC, London                    | Vereinigtes Königreich | Dreiparteiensicherheit  | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Weniger als ein Jahr | 16.223                             |
| HSBC Bank PLC, London                    | Vereinigtes Königreich | Dreiparteiensicherheit  | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 1.100.260                          |
| J.P. Morgan Chase Bank, New York         | USA                    | Bilaterale Sicherheit   | Staatsanleihe                                   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 366.064                            |
| J.P. Morgan Chase Bank, New York         | USA                    | Bilaterale Sicherheit   | Staatsanleihe                                   | AAA                       | NOK                 | Mehr als ein Jahr    | 91.657                             |
| J.P. Morgan Chase Bank, New York         | USA                    | Bilaterale Sicherheit   | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 29.572.174                         |
| J.P. Morgan Chase Bank, New York         | USA                    | Bilaterale Sicherheit   | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Weniger als ein Jahr | 93.424                             |
| J.P. Morgan Chase Bank, New York         | USA                    | Bilaterale Sicherheit   | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 1                                  |
| J.P. Morgan Chase Bank, New York         | USA                    | Dreiparteiensicherheit  | Staatsanleihe                                   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 3.043.862                          |
| J.P. Morgan Chase Bank, New York         | USA                    | Dreiparteiensicherheit  | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 845.376                            |
| J.P. Morgan Chase Bank, New York         | USA                    | Dreiparteiensicherheit  | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 2.843.345                          |
| J.P. Morgan Chase Bank, New York         | USA                    | Dreiparteiensicherheit  | Staatsanleihe                                   | AA+                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 1.282.504                          |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteiensicherheit  | Staatsanleihe                                   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 728.055                            |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteiensicherheit  | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 3.362.456                          |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteiensicherheit  | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 60.965                             |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteiensicherheit  | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 3.360.260                          |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteiensicherheit  | Staatsanleihe                                   | AA+                       | EUR                 | Weniger als ein Jahr | 502.422                            |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteiensicherheit  | Anleihe   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 1.199.179                          |
| Goldman Sachs International, London      | Vereinigtes Königreich | Dreiparteiensicherheit  | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 24.386.429                         |
| Goldman Sachs International, London      | Vereinigtes Königreich | Dreiparteiensicherheit  | Staatsanleihe                                   | AAA                       | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 4.389.253                          |
| BNP Paribas                              | Frankreich             | Dreiparteiensicherheit  | Staatsanleihe                                   | AAA                       | CAD                 | Mehr als ein Jahr    | 1.936.180                          |
| BNP Paribas                              | Frankreich             | Dreiparteiensicherheit  | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 6.908.120                          |
| BNP Paribas                              | Frankreich             | Dreiparteiensicherheit  | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Mehr als ein Jahr    | 561.185                            |
| BNP Paribas                              | Frankreich             | Dreiparteiensicherheit  | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Weniger als ein Jahr | 517.066                            |
| BNP Paribas                              | Frankreich             | Dreiparteiensicherheit  | Anleihe   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 180.947                            |
| BNP Paribas                              | Frankreich             | Dreiparteiensicherheit  | Anleihe   | AAA                       | CAD                 | Mehr als ein Jahr    | 1.068                              |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteiensicherheit  | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 1.448.139                          |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteiensicherheit  | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 191                                |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteiensicherheit  | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 1.459.483                          |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteiensicherheit  | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Mehr als ein Jahr    | 3.220.554                          |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteiensicherheit  | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Weniger als ein Jahr | 1.167.305                          |
| Royal Bank of Canada                     | Kanada                 | Dreiparteiensicherheit  | Aktien  | N/C                       | USD                 | N/C                  | 2.157                              |
| Royal Bank of Canada                     | Kanada                 | Dreiparteiensicherheit  | Staatsanleihe                                   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 18.623                             |
| Royal Bank of Canada                     | Kanada                 | Dreiparteiensicherheit  | Staatsanleihe                                   | AAA                       | AUD                 | Mehr als ein Jahr    | 355                                |
| Royal Bank of Canada                     | Kanada                 | Dreiparteiensicherheit  | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 4.220.131                          |
| Banco Santander                          | Spanien                | Dreiparteiensicherheit  | Staatsanleihe                                   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 11                                 |
| Banco Santander                          | Spanien                | Dreiparteiensicherheit  | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 1.745.772                          |
| Banco Santander                          | Spanien                | Dreiparteiensicherheit  | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 3.502.750                          |
| Banco Santander                          | Spanien                | Dreiparteiensicherheit  | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 1.747.889                          |
| Banco Santander                          | Spanien                | Dreiparteiensicherheit  | Staatsanleihe                                   | AA+                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 1.751.375                          |
| Deutsche Bank                            | Deutschland            | Dreiparteiensicherheit  | Staatsanleihe                                   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 818.116                            |
| Deutsche Bank                            | Deutschland            | Dreiparteiensicherheit  | Anleihe   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 726                                |
| Deutsche Bank                            | Deutschland            | Dreiparteiensicherheit  | Anleihe   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 490.590                            |
| Deutsche Bank                            | Deutschland            | Dreiparteiensicherheit  | Anleihe   | AA                        | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 383.475                            |
| Deutsche Bank                            | Deutschland            | Dreiparteiensicherheit  | Anleihe   | AA+                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 489.787                            |
| Deutsche Bank                            | Deutschland            | Dreiparteiensicherheit  | Medium Term Note                                | N/C                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 456.614                            |
| Jefferies International Limited          | Vereinigtes Königreich | Dreiparteiensicherheit  | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 2.435                              |
| Jefferies International Limited          | Vereinigtes Königreich | Dreiparteiensicherheit  | Anleihe   | AA+                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 981.940                            |

#### GEM Debt Total Return

| Sicherheitenkontrahent                   | Land des Kontrahenten  | Abwicklung und Clearing | Sicherheitstyp | Qualität der Sicherheit** | Sicherheitenwährung | Fälligkeitsprofil* | Beträge (in Währung des Teilfonds) |
|--|------------------------|-------------------------|----------------|---------------------------|---------------------|--------------------|------------------------------------|
| Nomura International, Pfc                | Japan                  | Dreiparteiensicherheit  | Staatsanleihe  | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr  | 902                                |
| Nomura International, Pfc                | Japan                  | Dreiparteiensicherheit  | Staatsanleihe  | AAA                       | CAD                 | Mehr als ein Jahr  | 1.096                              |
| Nomura International, Pfc                | Japan                  | Dreiparteiensicherheit  | Staatsanleihe  | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr  | 44.197                             |
| Nomura International, Pfc                | Japan                  | Dreiparteiensicherheit  | Staatsanleihe  | A+                        | JPY                 | Mehr als ein Jahr  | 264.233                            |
| Nomura International, Pfc                | Japan                  | Dreiparteiensicherheit  | Anleihe        | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr  | 4.923                              |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteiensicherheit  | Staatsanleihe  | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr  | 727.066                            |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteiensicherheit  | Staatsanleihe  | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr  | 2.328                              |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteiensicherheit  | Staatsanleihe  | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr  | 398.027                            |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteiensicherheit  | Anleihe        | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr  | 198.523                            |

#### Global Bond Total Return

| Sicherheitenkontrahent                   | Land des Kontrahenten  | Abwicklung und Clearing | Sicherheitstyp                                  | Qualität der Sicherheit** | Sicherheitenwährung | Fälligkeitsprofil*   | Beträge (in Währung des Teilfonds) |
|--|------------------------|-------------------------|---|---------------------------|---------------------|----------------------|------------------------------------|
| Barclays Bank Plc                        | Vereinigtes Königreich | Dreiparteiensicherheit  | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 338.472                            |
| Barclays Bank Plc                        | Vereinigtes Königreich | Dreiparteiensicherheit  | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 338.164                            |
| Barclays Bank Plc                        | Vereinigtes Königreich | Dreiparteiensicherheit  | Staatsanleihe                                   | AA+                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 497.385                            |
| Barclays Bank Plc                        | Vereinigtes Königreich | Dreiparteiensicherheit  | Anleihe   | AAA                       | CAD                 | Mehr als ein Jahr    | 337.598                            |
| Barclays Bank Plc                        | Vereinigtes Königreich | Dreiparteiensicherheit  | Barmittel, die vom Kontrahenten gehalten werden | N/C                       | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 708.011                            |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteiensicherheit  | Staatsanleihe                                   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 1.328.139                          |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteiensicherheit  | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 2.368.716                          |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteiensicherheit  | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 6.072                              |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteiensicherheit  | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 1.594.611                          |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteiensicherheit  | Staatsanleihe                                   | AA+                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 539.814                            |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteiensicherheit  | Anleihe   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 797.233                            |
| Goldman Sachs International, London      | Vereinigtes Königreich | Dreiparteiensicherheit  | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 1.558.228                          |
| Goldman Sachs International, London      | Vereinigtes Königreich | Dreiparteiensicherheit  | Staatsanleihe                                   | AAA                       | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 1.036.347                          |
| BNP Paribas                              | Frankreich             | Dreiparteiensicherheit  | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Mehr als ein Jahr    | 1.167.161                          |
| BNP Paribas                              | Frankreich             | Dreiparteiensicherheit  | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Weniger als ein Jahr | 1.075.533                          |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteiensicherheit  | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 471.945                            |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteiensicherheit  | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 76                                 |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteiensicherheit  | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 373.737                            |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteiensicherheit  | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Mehr als ein Jahr    | 760.957                            |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteiensicherheit  | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Weniger als ein Jahr | 756.071                            |

\* Die Kontrakte für die Wertpapierleihgeschäfte haben eine offene Laufzeit

\*\* S&P Long-term Issuer Rating

# Anhang VII (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte („SFT-Verordnung“) (Fortsetzung)

## Aggregierte Transaktionsdaten (Fortsetzung)

### Wertpapierleihgeschäfte (Fortsetzung)

#### Global Corporate Bond

| Sicherheitenkontrahent                   | Land des Kontrahenten  | Abwicklung und Clearing | Sicherheitstyp                                  | Qualität der Sicherheit** | Sicherheitenwährung | Fälligkeitsprofil*   | Beträge (in Währung des Teilfonds) |
|--|------------------------|-------------------------|---|---------------------------|---------------------|----------------------|------------------------------------|
| Barclays Bank Plc                        | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Aktien  | N/C                       | USD                 | N/C                  | 121.715.073                        |
| Barclays Bank Plc                        | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 457.704                            |
| Barclays Bank Plc                        | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 8.816.680                          |
| Barclays Bank Plc                        | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 16.456.343                         |
| Barclays Bank Plc                        | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Anleihe   | AAA                       | CAD                 | Mehr als ein Jahr    | 5.226.690                          |
| Barclays Bank Plc                        | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Barmittel, die vom Kontrahenten gehalten werden | N/C                       | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 3.726.189                          |
| Hong Kong & Shanghai Bank, Hongkong      | China                  | Dreiparteisicherheit    | Aktien  | N/C                       | USD                 | N/C                  | 1.237.585                          |
| Hong Kong & Shanghai Bank, Hongkong      | China                  | Dreiparteisicherheit    | Aktien  | N/C                       | JPY                 | N/C                  | 401.627                            |
| Hong Kong & Shanghai Bank, Hongkong      | China                  | Dreiparteisicherheit    | Aktien  | N/C                       | AUD                 | N/C                  | 413.098                            |
| Hong Kong & Shanghai Bank, Hongkong      | China                  | Dreiparteisicherheit    | Aktien  | N/C                       | HKD                 | N/C                  | 700.221                            |
| HSBC Bank PLC, London                    | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Aktien  | N/C                       | EUR                 | N/C                  | 1.467.195                          |
| HSBC Bank PLC, London                    | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | N/C                  | 4.662.404                          |
| HSBC Bank PLC, London                    | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 25.549.419                         |
| HSBC Bank PLC, London                    | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Weniger als ein Jahr | 872.441                            |
| HSBC Bank PLC, London                    | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | DKK                 | Mehr als ein Jahr    | 0                                  |
| HSBC Bank PLC, London                    | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 602                                |
| HSBC Bank PLC, London                    | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 6.240.778                          |
| Nomura International Plc                 | Japan                  | Bilaterale Sicherheit   | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 8.983                              |
| Nomura International Plc                 | Japan                  | Bilaterale Sicherheit   | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Weniger als ein Jahr | 1.956                              |
| Nomura International Plc                 | Japan                  | Dreiparteisicherheit    | Aktien  | N/C                       | JPY                 | N/C                  | 41.794.381                         |
| Nomura International Plc                 | Japan                  | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 333.768                            |
| Nomura International Plc                 | Japan                  | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 334.405                            |
| Nomura International Plc                 | Japan                  | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Mehr als ein Jahr    | 1.554.903                          |
| Nomura International Plc                 | Japan                  | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Weniger als ein Jahr | 331                                |
| Nomura International Plc                 | Japan                  | Dreiparteisicherheit    | Anleihe   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 9.75                               |
| J.P. Morgan Chase Bank, New York         | USA                    | Bilaterale Sicherheit   | Staatsanleihe                                   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 289.922                            |
| J.P. Morgan Chase Bank, New York         | USA                    | Bilaterale Sicherheit   | Staatsanleihe                                   | AAA                       | NOK                 | Mehr als ein Jahr    | -                                  |
| J.P. Morgan Chase Bank, New York         | USA                    | Bilaterale Sicherheit   | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 73.412.064                         |
| J.P. Morgan Chase Bank, New York         | USA                    | Bilaterale Sicherheit   | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Weniger als ein Jahr | -                                  |
| J.P. Morgan Chase Bank, New York         | USA                    | Bilaterale Sicherheit   | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | -                                  |
| J.P. Morgan Chase Bank, New York         | USA                    | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 73.164                             |
| J.P. Morgan Chase Bank, New York         | USA                    | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | EUR                 | Weniger als ein Jahr | 8.143                              |
| J.P. Morgan Chase Bank, New York         | USA                    | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 17.841                             |
| J.P. Morgan Chase Bank, New York         | USA                    | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 72.150                             |
| J.P. Morgan Chase Bank, New York         | USA                    | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | A+                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 32.190                             |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 100                                |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | AUD                 | Mehr als ein Jahr    | 9.263.480                          |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | AUD                 | Weniger als ein Jahr | 5.873.304                          |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 1.793.642                          |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 15.671.893                         |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | A+                        | EUR                 | Weniger als ein Jahr | 4.705.611                          |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Anleihe   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 5.083.788                          |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Anleihe   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 102.214                            |
| Goldman Sachs International, London      | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 84.795.880                         |
| Goldman Sachs International, London      | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 32.848.076                         |
| BNP Paribas                              | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 2.606.968                          |
| BNP Paribas                              | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | CAD                 | Mehr als ein Jahr    | 5.000.154                          |
| BNP Paribas                              | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 98.877                             |
| BNP Paribas                              | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | A+                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 20.724.545                         |
| BNP Paribas                              | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Mehr als ein Jahr    | 3.483.336                          |
| BNP Paribas                              | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Anleihe   | A+                        | JPY                 | Weniger als ein Jahr | 3.213.704                          |
| BNP Paribas                              | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Anleihe   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 891.747                            |
| BNP Paribas                              | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Anleihe   | AAA                       | CAD                 | Mehr als ein Jahr    | 4.748                              |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 3.675.733                          |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 3.680.180                          |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Mehr als ein Jahr    | 11.409.423                         |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Weniger als ein Jahr | 6.521.533                          |
| Royal Bank of Canada                     | Kanada                 | Dreiparteisicherheit    | Aktien  | N/C                       | USD                 | N/C                  | 21.988                             |
| Royal Bank of Canada                     | Kanada                 | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 156.225                            |
| Royal Bank of Canada                     | Kanada                 | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | AUD                 | Mehr als ein Jahr    | 984                                |
| Royal Bank of Canada                     | Kanada                 | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 25.386.707                         |
| Royal Bank of Canada                     | Kanada                 | Dreiparteisicherheit    | Anleihe   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 67.142                             |
| Banco Santander                          | Spanien                | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 14                                 |
| Banco Santander                          | Spanien                | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 2.704.695                          |
| Banco Santander                          | Spanien                | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 5.426.745                          |
| Banco Santander                          | Spanien                | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 2.707.971                          |
| Banco Santander                          | Spanien                | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | A+                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 2.713.373                          |
| Deutsche Bank                            | Deutschland            | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 774.622                            |
| Deutsche Bank                            | Deutschland            | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 11.097.548                         |
| Deutsche Bank                            | Deutschland            | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | A+                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 1.916.167                          |
| Deutsche Bank                            | Deutschland            | Dreiparteisicherheit    | Anleihe   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 6.073.723                          |
| Deutsche Bank                            | Deutschland            | Dreiparteisicherheit    | Anleihe   | AAA                       | CHF                 | Mehr als ein Jahr    | 73.937                             |
| Deutsche Bank                            | Deutschland            | Dreiparteisicherheit    | Anleihe   | AA                        | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 6.005.223                          |
| Deutsche Bank                            | Deutschland            | Dreiparteisicherheit    | Anleihe   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 6.095.659                          |
| Jefferies International Limited          | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 137.014                            |
| Jefferies International Limited          | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Anleihe   | A+                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 9.563.991                          |
| National Bank Financial Inc              | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Mehr als ein Jahr    | 2.714.066                          |
| National Bank Financial Inc              | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Weniger als ein Jahr | 516.575                            |

\* Die Kontrakte für die Wertpapierleihgeschäfte haben eine offene Laufzeit

\*\* S&P Long-term Issuer Rating

# Anhang VII (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte („SFT-Verordnung“) (Fortsetzung)

## Aggregierte Transaktionsdaten (Fortsetzung)

### Wertpapierleihgeschäfte (Fortsetzung)

#### Global Emerging Markets Bond

| Sicherheitenkontrahent                   | Land des Kontrahenten  | Abwicklung und Clearing | Sicherheitstyp                                  | Qualität der Sicherheit** | Sicherheitenwährung | Fälligkeitsprofil*   | Beträge (in Währung des Teilfonds) |
|--|------------------------|-------------------------|---|---------------------------|---------------------|----------------------|------------------------------------|
| Barclays Bank, P/c                       | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 11.099                             |
| Barclays Bank, P/c                       | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 3.778.758                          |
| Barclays Bank, P/c                       | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Anleihe   | AAA                       | CAD                 | Mehr als ein Jahr    | 1.888.403                          |
| Barclays Bank, P/c                       | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Barmittel, die vom Kontrahenten gehalten werden | N/C                       | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 6.587.338                          |
| Hong Kong & Shanghai Bank, Hongkong      | China                  | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Weniger als ein Jahr | 70.775                             |
| Hong Kong & Shanghai Bank, Hongkong      | China                  | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 297.536                            |
| Hong Kong & Shanghai Bank, Hongkong      | China                  | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Weniger als ein Jahr | 99.178                             |
| Hong Kong & Shanghai Bank, Hongkong      | China                  | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Weniger als ein Jahr | 193.237                            |
| HSBC Bank PLC, London                    | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Aktien  | N/C                       | EUR                 | N/C                  | 1.084.857                          |
| HSBC Bank PLC, London                    | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Aktien  | N/C                       | USD                 | N/C                  | 381.238                            |
| HSBC Bank PLC, London                    | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 6.269.652                          |
| HSBC Bank PLC, London                    | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Weniger als ein Jahr | 2.303                              |
| HSBC Bank PLC, London                    | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 1                                  |
| HSBC Bank PLC, London                    | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 8.679.997                          |
| Nomura International, P/c                | Japan                  | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 464.235                            |
| Nomura International, P/c                | Japan                  | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 1.349.666                          |
| Nomura International, P/c                | Japan                  | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Mehr als ein Jahr    | 7.101.750                          |
| Nomura International, P/c                | Japan                  | Dreiparteisicherheit    | Anleihe   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 62.399                             |
| J.P. Morgan Chase Bank, New York         | USA                    | Bilaterale Sicherheit   | Staatsanleihe                                   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | -                                  |
| J.P. Morgan Chase Bank, New York         | USA                    | Bilaterale Sicherheit   | Staatsanleihe                                   | AAA                       | NOK                 | Mehr als ein Jahr    | -                                  |
| J.P. Morgan Chase Bank, New York         | USA                    | Bilaterale Sicherheit   | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | -                                  |
| J.P. Morgan Chase Bank, New York         | USA                    | Bilaterale Sicherheit   | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Weniger als ein Jahr | -                                  |
| J.P. Morgan Chase Bank, New York         | USA                    | Bilaterale Sicherheit   | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | -                                  |
| J.P. Morgan Chase Bank, New York         | USA                    | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 221.678                            |
| J.P. Morgan Chase Bank, New York         | USA                    | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 516.888                            |
| J.P. Morgan Chase Bank, New York         | USA                    | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | CAD                 | Mehr als ein Jahr    | 517.239                            |
| J.P. Morgan Chase Bank, New York         | USA                    | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 919.497                            |
| J.P. Morgan Chase Bank, New York         | USA                    | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 414.028                            |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 603                                |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 16.272.567                         |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | AUD                 | Mehr als ein Jahr    | 57.754                             |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | AUD                 | Weniger als ein Jahr | 4.341.637                          |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 1.545.226                          |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 16.601.028                         |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 1.049.036                          |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Anleihe   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 6.555.602                          |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Anleihe   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 9.562                              |
| Goldman Sachs International, London      | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 12.531.067                         |
| Goldman Sachs International, London      | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Weniger als ein Jahr | 252.970                            |
| Goldman Sachs International, London      | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 5.974.292                          |
| BNP Paribas                              | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 1.245.263                          |
| BNP Paribas                              | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 4.497.581                          |
| BNP Paribas                              | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Mehr als ein Jahr    | 446.608                            |
| BNP Paribas                              | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Weniger als ein Jahr | 409.979                            |
| BNP Paribas                              | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Anleihe   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 525.925                            |
| BNP Paribas                              | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Anleihe   | AAA                       | CAD                 | Mehr als ein Jahr    | 20.773                             |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 932.693                            |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 86                                 |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 935.761                            |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Mehr als ein Jahr    | 1.172.189                          |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Weniger als ein Jahr | 2.806.653                          |
| Deutsche Bank                            | Deutschland            | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 2.453.830                          |
| Deutsche Bank                            | Deutschland            | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 511.375                            |
| Deutsche Bank                            | Deutschland            | Dreiparteisicherheit    | Anleihe   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 1.567                              |
| Deutsche Bank                            | Deutschland            | Dreiparteisicherheit    | Anleihe   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 1.029.613                          |
| Deutsche Bank                            | Deutschland            | Dreiparteisicherheit    | Anleihe   | AA                        | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 1.035.383                          |
| Deutsche Bank                            | Deutschland            | Dreiparteisicherheit    | Anleihe   | AA+                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 1.431.224                          |
| Jefferies International Limited          | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 108.600                            |
| Jefferies International Limited          | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Anleihe   | AA+                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 1.618.978                          |

#### Global Emerging Markets Local Debt

| Sicherheitenkontrahent              | Land des Kontrahenten  | Abwicklung und Clearing | Sicherheitstyp                                  | Qualität der Sicherheit** | Sicherheitenwährung | Fälligkeitsprofil*   | Beträge (in Währung des Teilfonds) |
|-------------------------------------|------------------------|-------------------------|---|---------------------------|---------------------|----------------------|------------------------------------|
| Barclays Bank, P/c                  | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 28.095                             |
| Barclays Bank, P/c                  | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 5.355.265                          |
| Barclays Bank, P/c                  | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Anleihe   | AAA                       | CAD                 | Mehr als ein Jahr    | 5.352.217                          |
| Barclays Bank, P/c                  | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Barmittel, die vom Kontrahenten gehalten werden | N/C                       | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 6.774.060                          |
| Hong Kong & Shanghai Bank, Hongkong | China                  | Dreiparteisicherheit    | Aktien  | N/C                       | USD                 | N/C                  | 115.497.686                        |
| HSBC Bank PLC, London               | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Aktien  | N/C                       | USD                 | N/C                  | 538.588                            |
| HSBC Bank PLC, London               | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 13.329.180                         |
| HSBC Bank PLC, London               | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Weniger als ein Jahr | 2.977.955                          |
| HSBC Bank PLC, London               | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 9.199.507                          |
| BNP Paribas                         | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Mehr als ein Jahr    | 6.476.452                          |
| BNP Paribas                         | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Weniger als ein Jahr | 5.977.424                          |

\* Die Kontrakte für die Wertpapierleihgeschäfte haben eine offene Laufzeit

\*\* S&P Long-term Issuer Rating

# Anhang VII (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte („SFT-Verordnung“) (Fortsetzung)

## Aggregierte Transaktionsdaten (Fortsetzung)

### Wertpapierleihgeschäfte (Fortsetzung)

| Global Government Bond                   |                        |                         |   |                           |                     |                      |                                    |
|--|------------------------|-------------------------|---|---------------------------|---------------------|----------------------|------------------------------------|
| Sicherheitenkontrahent                   | Land des Kontrahenten  | Abwicklung und Clearing | Sicherheitstyp                                  | Qualität der Sicherheit** | Sicherheitenwährung | Fälligkeitsprofil*   | Beträge (in Währung des Teilfonds) |
| Barclays Bank, P/c                       | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Aktien  | N/C                       | USD                 | N/C                  | 94.851.901                         |
| Barclays Bank, P/c                       | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 357.038                            |
| Barclays Bank, P/c                       | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 6.107                              |
| Barclays Bank, P/c                       | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 509.226                            |
| Barclays Bank, P/c                       | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Barmittel, die vom Kontrahenten gehalten werden | N/C                       | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 2.324.346                          |
| Hong Kong & Shanghai Bank, Hongkong      | China                  | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Weniger als ein Jahr | 1.371.793                          |
| Hong Kong & Shanghai Bank, Hongkong      | China                  | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 7.114.462                          |
| Hong Kong & Shanghai Bank, Hongkong      | China                  | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Weniger als ein Jahr | 1.510.588                          |
| Hong Kong & Shanghai Bank, Hongkong      | China                  | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Weniger als ein Jahr | 74.783                             |
| Nomura International, P/c                | Japan                  | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 5.286.058                          |
| Nomura International, P/c                | Japan                  | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 965.880                            |
| Nomura International, P/c                | Japan                  | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | AUD                 | Mehr als ein Jahr    | 228.495                            |
| Nomura International, P/c                | Japan                  | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 538.523                            |
| Nomura International, P/c                | Japan                  | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA+                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 3.856.242                          |
| Nomura International, P/c                | Japan                  | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA+                       | EUR                 | Weniger als ein Jahr | 2.611.624                          |
| Nomura International, P/c                | Japan                  | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Mehr als ein Jahr    | 56.032.345                         |
| Nomura International, P/c                | Japan                  | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Weniger als ein Jahr | 719.137                            |
| Nomura International, P/c                | Japan                  | Dreiparteisicherheit    | Anleihe   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 311.829                            |
| Nomura International, P/c                | Japan                  | Dreiparteisicherheit    | Anleihe   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 1.007.233                          |
| TD Securities, Inc                       | Kanada                 | Dreiparteisicherheit    | Aktien  | N/C                       | USD                 | N/C                  | 187.198.267                        |
| TD Securities, Inc                       | Kanada                 | Dreiparteisicherheit    | Aktien  | N/C                       | CAD                 | N/C                  | 46.855.700                         |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 2.356.334                          |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | AUD                 | Mehr als ein Jahr    | 2.345.884                          |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 83.264                             |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 5.903.122                          |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA+                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 1.867.806                          |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Anleihe   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 2.189.012                          |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Anleihe   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 418.998                            |
| BNP Paribas                              | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Aktien  | N/C                       | EUR                 | N/C                  | 28.756.308                         |
| BNP Paribas                              | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Aktien  | N/C                       | GBP                 | N/C                  | 13.529.968                         |
| BNP Paribas                              | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Aktien  | N/C                       | USD                 | N/C                  | 29.548.037                         |
| BNP Paribas                              | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Aktien  | N/C                       | AUD                 | N/C                  | 3.896.104                          |
| BNP Paribas                              | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Aktien  | N/C                       | CHF                 | N/C                  | 791                                |
| BNP Paribas                              | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Aktien  | N/C                       | HKD                 | N/C                  | 60.188                             |
| BNP Paribas                              | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | CAD                 | Mehr als ein Jahr    | 23.255.649                         |
| BNP Paribas                              | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 48.497.241                         |
| BNP Paribas                              | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Mehr als ein Jahr    | 13.814.218                         |
| BNP Paribas                              | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Anleihe   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 105.185                            |
| BNP Paribas                              | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Anleihe   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 7.628.849                          |
| Barclays Bank, London                    | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 728                                |
| Barclays Bank, London                    | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 10.936.994                         |
| Barclays Bank, London                    | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 4.427.611                          |
| Barclays Bank, London                    | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA+                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 8.872.145                          |
| Barclays Bank, London                    | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Mehr als ein Jahr    | 8.240.255                          |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 3.049.662                          |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 398                                |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Mehr als ein Jahr    | 7.348.748                          |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Weniger als ein Jahr | 4.895.242                          |
| Natixis                                  | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | CAD                 | Mehr als ein Jahr    | 9.314.955                          |
| Natixis                                  | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA+                       | EUR                 | Weniger als ein Jahr | 2.556.606                          |
| Natixis                                  | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Mehr als ein Jahr    | 940.769                            |
| Natixis                                  | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Anleihe   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 4.429.783                          |
| Royal Bank of Canada                     | Kanada                 | Dreiparteisicherheit    | Aktien  | N/C                       | CAD                 | N/C                  | 334.247.792                        |
| NBC Global Finance Limited               | Irland                 | Dreiparteisicherheit    | Aktien  | N/C                       | USD                 | N/C                  | 48.527.805                         |

\* Die Kontrakte für die Wertpapierleihgeschäfte haben eine offene Laufzeit

\*\* S&P Long-term Issuer Rating

# Anhang VII (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte („SFT-Verordnung“) (Fortsetzung)

## Aggregierte Transaktionsdaten (Fortsetzung)

### Wertpapierleihgeschäfte (Fortsetzung)

Global High Income Bond

| Sicherheitenkontrahent                   | Land des Kontrahenten  | Abwicklung und Clearing | Sicherheitstyp                                  | Qualität der Sicherheit** | Sicherheitenwährung | Fälligkeitsprofil*   | Beträge (in Währung des Teilfonds) |
|--|------------------------|-------------------------|---|---------------------------|---------------------|----------------------|------------------------------------|
| Barclays Bank Plc                        | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 2.220                              |
| Barclays Bank Plc                        | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 1.611.956                          |
| Barclays Bank Plc                        | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Barmittel, die vom Kontrahenten gehalten werden | N/C                       | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 3.580.016                          |
| Hong Kong & Shanghai Bank, Hongkong      | China                  | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Weniger als ein Jahr | 75.269                             |
| Hong Kong & Shanghai Bank, Hongkong      | China                  | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Weniger als ein Jahr | 113.222                            |
| Hong Kong & Shanghai Bank, Hongkong      | China                  | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 565.595                            |
| HSBC Bank PLC, London                    | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Aktien  | N/C                       | EUR                 | N/C                  | 262.333                            |
| HSBC Bank PLC, London                    | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Aktien  | N/C                       | USD                 | N/C                  | 553.880                            |
| HSBC Bank PLC, London                    | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 1.300.700                          |
| HSBC Bank PLC, London                    | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Weniger als ein Jahr | 17.521                             |
| HSBC Bank PLC, London                    | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 375.410                            |
| Nomura International Plc                 | Japan                  | Bilaterale Sicherheit   | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 4.491                              |
| Nomura International Plc                 | Japan                  | Bilaterale Sicherheit   | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Weniger als ein Jahr | 978                                |
| Nomura International Plc                 | Japan                  | Dreiparteisicherheit    | Aktien  | N/C                       | JPY                 | N/C                  | 48.933.387                         |
| Nomura International Plc                 | Japan                  | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 103.988                            |
| Nomura International Plc                 | Japan                  | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 14.683                             |
| Nomura International Plc                 | Japan                  | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA+                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 518                                |
| Nomura International Plc                 | Japan                  | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA+                       | EUR                 | Weniger als ein Jahr | 17.732                             |
| Nomura International Plc                 | Japan                  | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Mehr als ein Jahr    | 7.054.833                          |
| Nomura International Plc                 | Japan                  | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Weniger als ein Jahr | 60.073                             |
| Nomura International Plc                 | Japan                  | Dreiparteisicherheit    | Anleihe   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 14.680                             |
| J.P. Morgan Chase Bank, New York         | USA                    | Bilaterale Sicherheit   | Staatsanleihe                                   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 102.107                            |
| J.P. Morgan Chase Bank, New York         | USA                    | Bilaterale Sicherheit   | Staatsanleihe                                   | AAA                       | NOK                 | Mehr als ein Jahr    | -                                  |
| J.P. Morgan Chase Bank, New York         | USA                    | Bilaterale Sicherheit   | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 26.008.370                         |
| J.P. Morgan Chase Bank, New York         | USA                    | Bilaterale Sicherheit   | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Weniger als ein Jahr | -                                  |
| J.P. Morgan Chase Bank, New York         | USA                    | Bilaterale Sicherheit   | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | -                                  |
| J.P. Morgan Chase Bank, New York         | USA                    | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 280.846                            |
| J.P. Morgan Chase Bank, New York         | USA                    | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 695.669                            |
| J.P. Morgan Chase Bank, New York         | USA                    | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | CAD                 | Mehr als ein Jahr    | 157.075                            |
| J.P. Morgan Chase Bank, New York         | USA                    | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 1.237.477                          |
| J.P. Morgan Chase Bank, New York         | USA                    | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 557.136                            |
| J.P. Morgan Chase Bank, New York         | USA                    | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA+                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 557.639                            |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 3.972.903                          |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | AUD                 | Mehr als ein Jahr    | 2.986.200                          |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 102.107                            |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 9.863.661                          |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Anleihe   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 2.982.087                          |
| Goldman Sachs International, London      | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 33.812.662                         |
| Goldman Sachs International, London      | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Weniger als ein Jahr | 6.673.847                          |
| Goldman Sachs International, London      | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 7.286.007                          |
| BNP Paribas                              | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 2.336.309                          |
| BNP Paribas                              | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 5.843.183                          |
| BNP Paribas                              | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Mehr als ein Jahr    | 650.208                            |
| BNP Paribas                              | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Weniger als ein Jahr | 597.445                            |
| BNP Paribas                              | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Anleihe   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 105.185                            |
| BNP Paribas                              | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Anleihe   | AAA                       | CAD                 | Mehr als ein Jahr    | 24.927                             |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 433.667                            |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 106.812                            |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA+                       | JPY                 | Mehr als ein Jahr    | 871.654                            |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Weniger als ein Jahr | 1.302.697                          |
| Royal Bank of Canada                     | Kanada                 | Dreiparteisicherheit    | Aktien  | N/C                       | USD                 | N/C                  | 603                                |
| Royal Bank of Canada                     | Kanada                 | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 14.002                             |
| Royal Bank of Canada                     | Kanada                 | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | AUD                 | Mehr als ein Jahr    | 384                                |
| Royal Bank of Canada                     | Kanada                 | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 1.189.243                          |
| Banco Santander                          | Spanien                | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 24                                 |
| Banco Santander                          | Spanien                | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 1.004.362                          |
| Banco Santander                          | Spanien                | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 2.015.207                          |
| Banco Santander                          | Spanien                | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 1.005.598                          |
| Banco Santander                          | Spanien                | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA+                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 1.007.604                          |

\* Die Kontrakte für die Wertpapierleihgeschäfte haben eine offene Laufzeit

\*\* S&P Long-term Issuer Rating

# Anhang VII (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte („SFT-Verordnung“) (Fortsetzung)

## Aggregierte Transaktionsdaten (Fortsetzung)

### Wertpapierleihgeschäfte (Fortsetzung)

Global High Yield Bond

| Sicherheitenkontrahent                   | Land des Kontrahenten  | Abwicklung und Clearing | Sicherheitstyp                                  | Qualität der Sicherheit** | Sicherheitenwährung | Fälligkeitsprofil*   | Beträge (in Währung des Teilfonds) |
|--|------------------------|-------------------------|---|---------------------------|---------------------|----------------------|------------------------------------|
| Barclays Bank Plc                        | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 14.428                             |
| Barclays Bank Plc                        | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 5.417.401                          |
| Barclays Bank Plc                        | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Anleihe   | AAA                       | CAD                 | Mehr als ein Jahr    | 5.414.066                          |
| Barclays Bank Plc                        | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Barmittel, die vom Kontrahenten gehalten werden | N/C                       | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 6.866.213                          |
| Hong Kong & Shanghai Bank, Hongkong      | China                  | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Weniger als ein Jahr | 266.113                            |
| Hong Kong & Shanghai Bank, Hongkong      | China                  | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 1.174.044                          |
| Hong Kong & Shanghai Bank, Hongkong      | China                  | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Weniger als ein Jahr | 265.871                            |
| Hong Kong & Shanghai Bank, Hongkong      | China                  | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Weniger als ein Jahr | 66.508                             |
| HSBC Bank PLC, London                    | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Aktien  | N/C                       | EUR                 | N/C                  | 861.193                            |
| HSBC Bank PLC, London                    | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 4.398.953                          |
| HSBC Bank PLC, London                    | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 1.232.063                          |
| Nomura International Plc                 | Japan                  | Bilaterale Sicherheit   | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 4.491                              |
| Nomura International Plc                 | Japan                  | Bilaterale Sicherheit   | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Weniger als ein Jahr | 978                                |
| Nomura International Plc                 | Japan                  | Dreiparteisicherheit    | Aktien  | N/C                       | JPY                 | N/C                  | 50.747.867                         |
| Nomura International Plc                 | Japan                  | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 66.432                             |
| Nomura International Plc                 | Japan                  | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | CAD                 | Mehr als ein Jahr    | 79.793                             |
| Nomura International Plc                 | Japan                  | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 4.969                              |
| Nomura International Plc                 | Japan                  | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA+                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 7.636                              |
| Nomura International Plc                 | Japan                  | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Mehr als ein Jahr    | 390.641                            |
| Nomura International Plc                 | Japan                  | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA+                       | JPY                 | Weniger als ein Jahr | 4.638.687                          |
| Nomura International Plc                 | Japan                  | Dreiparteisicherheit    | Anleihe   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 10.838                             |
| J.P. Morgan Chase Bank, New York         | USA                    | Bilaterale Sicherheit   | Staatsanleihe                                   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 105.426                            |
| J.P. Morgan Chase Bank, New York         | USA                    | Bilaterale Sicherheit   | Staatsanleihe                                   | AAA                       | NOK                 | Mehr als ein Jahr    | 55.021                             |
| J.P. Morgan Chase Bank, New York         | USA                    | Bilaterale Sicherheit   | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 7.426.707                          |
| J.P. Morgan Chase Bank, New York         | USA                    | Bilaterale Sicherheit   | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Weniger als ein Jahr | -                                  |
| J.P. Morgan Chase Bank, New York         | USA                    | Bilaterale Sicherheit   | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | -                                  |
| J.P. Morgan Chase Bank, New York         | USA                    | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 375.398                            |
| J.P. Morgan Chase Bank, New York         | USA                    | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 471.555                            |
| J.P. Morgan Chase Bank, New York         | USA                    | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | CAD                 | Mehr als ein Jahr    | 103.134                            |
| J.P. Morgan Chase Bank, New York         | USA                    | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 838.823                            |
| J.P. Morgan Chase Bank, New York         | USA                    | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 196.579                            |
| J.P. Morgan Chase Bank, New York         | USA                    | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA+                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 377.756                            |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 1.093.752                          |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 3.453                              |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 597.565                            |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Anleihe   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 294.155                            |
| Goldman Sachs International, London      | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 27.893.728                         |
| Goldman Sachs International, London      | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 5.017.021                          |
| BNP Paribas                              | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 1.906.033                          |
| BNP Paribas                              | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 5.461.995                          |
| BNP Paribas                              | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Mehr als ein Jahr    | 1.092.269                          |
| BNP Paribas                              | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Weniger als ein Jahr | 1.006.101                          |
| BNP Paribas                              | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Anleihe   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 420.740                            |
| BNP Paribas                              | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Anleihe   | AAA                       | CAD                 | Mehr als ein Jahr    | 24.927                             |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Aktien  | N/C                       | GBP                 | N/C                  | 119                                |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 943.838                            |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 354                                |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 90.697                             |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Mehr als ein Jahr    | 3.717.408                          |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Weniger als ein Jahr | 1.013.970                          |
| Royal Bank of Canada                     | Kanada                 | Dreiparteisicherheit    | Aktien  | N/C                       | USD                 | N/C                  | 1.615                              |
| Royal Bank of Canada                     | Kanada                 | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 43.109                             |
| Royal Bank of Canada                     | Kanada                 | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | AUD                 | Mehr als ein Jahr    | 384                                |
| Royal Bank of Canada                     | Kanada                 | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 3.600.784                          |
| Banco Santander                          | Spanien                | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 48                                 |
| Banco Santander                          | Spanien                | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 105.509                            |
| Banco Santander                          | Spanien                | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 211.791                            |
| Banco Santander                          | Spanien                | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 105.685                            |
| Banco Santander                          | Spanien                | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA+                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 105.896                            |
| Jefferies International Limited          | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 190.175                            |
| Jefferies International Limited          | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 7.863                              |
| Jefferies International Limited          | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Anleihe   | AA+                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 1.263.072                          |

\* Die Kontrakte für die Wertpapierleihgeschäfte haben eine offene Laufzeit

\*\* S&P Long-term Issuer Rating



# Anhang VII (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte („SFT-Verordnung“) (Fortsetzung)

## Aggregierte Transaktionsdaten (Fortsetzung)

### Wertpapierleihgeschäfte (Fortsetzung)

| Global Inflation Linked Bond        |                        |                         |                |                           |                     |                      |                                    |
|-------------------------------------|------------------------|-------------------------|----------------|---------------------------|---------------------|----------------------|------------------------------------|
| Sicherheitenkontrahent              | Land des Kontrahenten  | Abwicklung und Clearing | Sicherheitstyp | Qualität der Sicherheit** | Sicherheitenwährung | Fälligkeitsprofil*   | Beträge (in Währung des Teilfonds) |
| Bank of Nova Scotia                 | Kanada                 | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 224.479                            |
| Bank of Nova Scotia                 | Kanada                 | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 223.787                            |
| Bank of Nova Scotia                 | Kanada                 | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | AAA                       | CAD                 | Weniger als ein Jahr | 1.431                              |
| Bank of Nova Scotia                 | Kanada                 | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 224.562                            |
| Bank of Nova Scotia                 | Kanada                 | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 223.351                            |
| Bank of Nova Scotia                 | Kanada                 | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | AA+                       | EUR                 | Weniger als ein Jahr | 4.257                              |
| Bank of Nova Scotia                 | Kanada                 | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | A+                        | JPY                 | Mehr als ein Jahr    | 219.343                            |
| Barclays Bank Plc                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Aktien         | N/C                       | USD                 | N/C                  | 33.221.119                         |
| Hong Kong & Shanghai Bank, Hongkong | China                  | Dreiparteisicherheit    | Aktien         | N/C                       | USD                 | N/C                  | 32.508.997                         |
| Hong Kong & Shanghai Bank, Hongkong | China                  | Dreiparteisicherheit    | Aktien         | N/C                       | JPY                 | N/C                  | 14.604.994                         |
| Hong Kong & Shanghai Bank, Hongkong | China                  | Dreiparteisicherheit    | Aktien         | N/C                       | AUD                 | N/C                  | 974.922                            |
| Hong Kong & Shanghai Bank, Hongkong | China                  | Dreiparteisicherheit    | Aktien         | N/C                       | HKD                 | N/C                  | 20.831.254                         |
| Hong Kong & Shanghai Bank, Hongkong | China                  | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | A+                        | JPY                 | Mehr als ein Jahr    | 531.757                            |
| Hong Kong & Shanghai Bank, Hongkong | China                  | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | A+                        | JPY                 | Weniger als ein Jahr | 35.046                             |
| HSBC Bank PLC, London               | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Aktien         | N/C                       | EUR                 | N/C                  | 2.340.652                          |
| HSBC Bank PLC, London               | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Aktien         | N/C                       | GBP                 | N/C                  | 12.819.931                         |
| HSBC Bank PLC, London               | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Aktien         | N/C                       | USD                 | N/C                  | 3.490.448                          |
| HSBC Bank PLC, London               | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 4.450.705                          |

| Global Short Duration Bond               |                        |                         |                |                           |                     |                      |                                    |
|--|------------------------|-------------------------|----------------|---------------------------|---------------------|----------------------|------------------------------------|
| Sicherheitenkontrahent                   | Land des Kontrahenten  | Abwicklung und Clearing | Sicherheitstyp | Qualität der Sicherheit** | Sicherheitenwährung | Fälligkeitsprofil*   | Beträge (in Währung des Teilfonds) |
| Nomura International, Ptc                | Japan                  | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 102                                |
| Nomura International, Ptc                | Japan                  | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 1.097.089                          |
| Nomura International, Ptc                | Japan                  | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | AA+                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 1.144.809                          |
| Nomura International, Ptc                | Japan                  | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | AA+                       | EUR                 | Weniger als ein Jahr | 54.653                             |
| Nomura International, Ptc                | Japan                  | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | A+                        | JPY                 | Mehr als ein Jahr    | 4.242.469                          |
| Nomura International, Ptc                | Japan                  | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | A+                        | JPY                 | Weniger als ein Jahr | 599.276                            |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 5.222.683                          |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 2.819                              |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | AAA                       | AUD                 | Mehr als ein Jahr    | 6.470.804                          |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 111.363                            |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 24.470.066                         |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | AA+                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 1.865.175                          |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | AA+                       | EUR                 | Weniger als ein Jahr | 5.139.929                          |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Anleihe        | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 541.538                            |
| Goldman Sachs International, London      | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 21.415.108                         |
| Goldman Sachs International, London      | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | AAA                       | USD                 | Weniger als ein Jahr | 4.693.474                          |
| Goldman Sachs International, London      | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 4.698.576                          |
| BNP Paribas                              | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Aktien         | N/C                       | EUR                 | N/C                  | 21.955.895                         |
| BNP Paribas                              | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Aktien         | N/C                       | GBP                 | N/C                  | 10.356.416                         |
| BNP Paribas                              | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Aktien         | N/C                       | USD                 | N/C                  | 21.885.580                         |
| BNP Paribas                              | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 6.269.223                          |
| BNP Paribas                              | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | AAA                       | JPY                 | Mehr als ein Jahr    | 16.807.688                         |
| BNP Paribas                              | Frankreich             | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | A+                        | JPY                 | Weniger als ein Jahr | 5.216.318                          |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 17.402.475                         |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 163                                |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | A+                        | JPY                 | Mehr als ein Jahr    | 55.831.376                         |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe  | A+                        | JPY                 | Weniger als ein Jahr | 13.953.459                         |
| Royal Bank of Canada                     | Kanada                 | Dreiparteisicherheit    | Aktien         | N/C                       | GBP                 | N/C                  | 15.501.505                         |
| Royal Bank of Canada                     | Kanada                 | Dreiparteisicherheit    | Aktien         | N/C                       | USD                 | N/C                  | 5.585.024                          |
| Royal Bank of Canada                     | Kanada                 | Dreiparteisicherheit    | Aktien         | N/C                       | AUD                 | N/C                  | 10.063.806                         |

| US Short Duration High Yield Bond** |                        |                         |   |                           |                     |                    |                                    |
|-------------------------------------|------------------------|-------------------------|---|---------------------------|---------------------|--------------------|------------------------------------|
| Sicherheitenkontrahent              | Land des Kontrahenten  | Abwicklung und Clearing | Sicherheitstyp                                  | Qualität der Sicherheit** | Sicherheitenwährung | Fälligkeitsprofil* | Beträge (in Währung des Teilfonds) |
| Barclays Bank, Ptc                  | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr  | 3.360                              |
| Barclays Bank, Ptc                  | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr  | 989                                |
| Barclays Bank, Ptc                  | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr  | 191.585                            |
| Barclays Bank, Ptc                  | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Barmittel, die vom Kontrahenten gehalten werden | N/C                       | GBP                 | Mehr als ein Jahr  | 1.029.824                          |
| Goldman Sachs International, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr  | 6.787.181                          |
| Goldman Sachs International, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr  | 5.720.894                          |
| Morgan Stanley, London              | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr  | 60.838                             |
| Morgan Stanley, London              | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Mehr als ein Jahr  | 195.544                            |
| Morgan Stanley, London              | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Mehr als ein Jahr  | 48.945                             |
| Royal Bank of Canada                | Kanada                 | Dreiparteisicherheit    | Aktien  | N/C                       | USD                 | N/C                | 302                                |
| Royal Bank of Canada                | Kanada                 | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr  | 170.431                            |
| Royal Bank of Canada                | Kanada                 | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | AUD                 | Mehr als ein Jahr  | 56.422                             |
| Royal Bank of Canada                | Kanada                 | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr  | 152.710                            |

| RMB Fixed Income                         |                        |                         |   |                           |                     |                      |                                    |
|--|------------------------|-------------------------|---|---------------------------|---------------------|----------------------|------------------------------------|
| Sicherheitenkontrahent                   | Land des Kontrahenten  | Abwicklung und Clearing | Sicherheitstyp                                  | Qualität der Sicherheit** | Sicherheitenwährung | Fälligkeitsprofil*   | Beträge (in Währung des Teilfonds) |
| Barclays Bank, Ptc                       | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 3.362                              |
| Barclays Bank, Ptc                       | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 288                                |
| Barclays Bank, Ptc                       | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 138.412                            |
| Barclays Bank, Ptc                       | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Barmittel, die vom Kontrahenten gehalten werden | N/C                       | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 743.516                            |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 1                                  |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 726.941                            |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 2.328                              |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 398.143                            |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Anleihe   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 196.529                            |
| Goldman Sachs International, London      | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 57.876                             |
| Goldman Sachs International, London      | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 324.431                            |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 111.917                            |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 207                                |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Mehr als ein Jahr    | 358.406                            |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheit    | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Weniger als ein Jahr | 89.623                             |

\* Die Kontrakte für die Wertpapierleihgeschäfte haben eine offene Laufzeit

\*\* S&P Long-term Issuer Rating

\*\*\* Bis zum 3. Juli 2023 lautete der Name des Teilfonds „Global Short Duration High Yield Bond“

# Anhang VII (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte („SFT-Verordnung“) (Fortsetzung)

## Aggregierte Transaktionsdaten (Fortsetzung)

### Wertpapierleihgeschäfte (Fortsetzung)

#### Singapore Dollar Income Bond

| Sicherheitenkontrahent                   | Land des Kontrahenten  | Abwicklung und Clearing | Sicherheitstyp                                  | Qualität der Sicherheit** | Sicherheitenwährung | Fälligkeitsprofil*   | Beträge (in Währung des Teilfonds) |
|--|------------------------|-------------------------|---|---------------------------|---------------------|----------------------|------------------------------------|
| Barclays Bank Plc                        | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheits   | Staatsanleihe                                   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 4.494                              |
| Barclays Bank Plc                        | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheits   | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 579.756                            |
| Barclays Bank Plc                        | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheits   | Barmittel, die vom Kontrahenten gehalten werden | N/C                       | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 3.124.568                          |
| Nomura International Plc                 | Japan                  | Dreiparteisicherheits   | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 506.471                            |
| Nomura International Plc                 | Japan                  | Dreiparteisicherheits   | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Mehr als ein Jahr    | 3.687.713                          |
| Nomura International Plc                 | Japan                  | Dreiparteisicherheits   | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Weniger als ein Jahr | 701.338                            |
| Nomura International Plc                 | Japan                  | Dreiparteisicherheits   | Anleihe   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 259.873                            |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheits   | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 1.587.432                          |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheits   | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 409.594                            |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheits   | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 2.674.293                          |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheits   | Staatsanleihe                                   | AA+                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 791.131                            |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheits   | Anleihe   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 806.608                            |
| Goldman Sachs International, London      | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheits   | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 5.662.282                          |
| Goldman Sachs International, London      | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheits   | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Weniger als ein Jahr | 160.600                            |
| Goldman Sachs International, London      | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheits   | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 1.149.547                          |
| Goldman Sachs International, London      | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheits   | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Mehr als ein Jahr    | 416.249                            |
| Goldman Sachs International, London      | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheits   | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Weniger als ein Jahr | 160.628                            |
| BNP Paribas                              | Frankreich             | Dreiparteisicherheits   | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Mehr als ein Jahr    | 1.027.999                          |
| BNP Paribas                              | Frankreich             | Dreiparteisicherheits   | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Weniger als ein Jahr | 946.869                            |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheits   | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 521.067                            |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheits   | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 59                                 |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheits   | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Mehr als ein Jahr    | 2.087.648                          |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheits   | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Weniger als ein Jahr | 1.339                              |

#### Ultra Short Duration Bond

| Sicherheitenkontrahent      | Land des Kontrahenten  | Abwicklung und Clearing | Sicherheitstyp | Qualität der Sicherheit** | Sicherheitenwährung | Fälligkeitsprofil*   | Beträge (in Währung des Teilfonds) |
|-----------------------------|------------------------|-------------------------|----------------|---------------------------|---------------------|----------------------|------------------------------------|
| National Bank Financial Inc | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheits   | Staatsanleihe  | A+                        | JPY                 | Mehr als ein Jahr    | 39.555.436                         |
| National Bank Financial Inc | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheits   | Staatsanleihe  | A+                        | JPY                 | Weniger als ein Jahr | 7.533.997                          |

#### US Dollar Bond

| Sicherheitenkontrahent              | Land des Kontrahenten  | Abwicklung und Clearing | Sicherheitstyp | Qualität der Sicherheit** | Sicherheitenwährung | Fälligkeitsprofil*   | Beträge (in Währung des Teilfonds) |
|-------------------------------------|------------------------|-------------------------|----------------|---------------------------|---------------------|----------------------|------------------------------------|
| Goldman Sachs International, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheits   | Staatsanleihe  | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 7.293.065                          |
| Goldman Sachs International, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheits   | Staatsanleihe  | AAA                       | USD                 | Weniger als ein Jahr | 1.584.676                          |
| Goldman Sachs International, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheits   | Staatsanleihe  | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 1.507.551                          |

#### US High Yield Bond

| Sicherheitenkontrahent                   | Land des Kontrahenten  | Abwicklung und Clearing | Sicherheitstyp                                  | Qualität der Sicherheit** | Sicherheitenwährung | Fälligkeitsprofil*   | Beträge (in Währung des Teilfonds) |
|--|------------------------|-------------------------|---|---------------------------|---------------------|----------------------|------------------------------------|
| Barclays Bank Plc                        | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheits   | Staatsanleihe                                   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 1.110                              |
| Barclays Bank Plc                        | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheits   | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 324                                |
| Barclays Bank Plc                        | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheits   | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 62.335                             |
| Barclays Bank Plc                        | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheits   | Barmittel, die vom Kontrahenten gehalten werden | N/C                       | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 335.049                            |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheits   | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 399.169                            |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheits   | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 1.051                              |
| Merrill Lynch International Bank, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheits   | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 262.578                            |
| Goldman Sachs International, London      | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheits   | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 651.989                            |
| Goldman Sachs International, London      | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheits   | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 421.337                            |
| BNP Paribas                              | Frankreich             | Dreiparteisicherheits   | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Mehr als ein Jahr    | 129.440                            |
| BNP Paribas                              | Frankreich             | Dreiparteisicherheits   | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Weniger als ein Jahr | 119.026                            |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheits   | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 56.866                             |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheits   | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 219                                |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheits   | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Mehr als ein Jahr    | 227.641                            |
| Morgan Stanley, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheits   | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Weniger als ein Jahr | 661                                |

#### Global Credit Floating Rate Fixed Term Bond 2023 – 1 (geschlossen zum 5. Juli 2023)

| Sicherheitenkontrahent   | Land des Kontrahenten | Abwicklung und Clearing | Sicherheitstyp | Qualität der Sicherheit** | Sicherheitenwährung | Fälligkeitsprofil*   | Beträge (in Währung des Teilfonds) |
|--------------------------|-----------------------|-------------------------|----------------|---------------------------|---------------------|----------------------|------------------------------------|
| Nomura International Plc | Japan                 | Bilaterale Sicherheit   | Staatsanleihe  | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | -                                  |
| Nomura International Plc | Japan                 | Bilaterale Sicherheit   | Staatsanleihe  | AAA                       | USD                 | Weniger als ein Jahr | -                                  |

#### Global Credit Floating Rate Fixed Term Bond 2023 – 2 (geschlossen zum 29. Dezember 2023)

| Sicherheitenkontrahent   | Land des Kontrahenten | Abwicklung und Clearing | Sicherheitstyp | Qualität der Sicherheit** | Sicherheitenwährung | Fälligkeitsprofil*   | Beträge (in Währung des Teilfonds) |
|--------------------------|-----------------------|-------------------------|----------------|---------------------------|---------------------|----------------------|------------------------------------|
| Nomura International Plc | Japan                 | Bilaterale Sicherheit   | Staatsanleihe  | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | -                                  |
| Nomura International Plc | Japan                 | Bilaterale Sicherheit   | Staatsanleihe  | AAA                       | USD                 | Weniger als ein Jahr | -                                  |

#### Managed Solutions – Asia Focused Conservative

| Sicherheitenkontrahent | Land des Kontrahenten | Abwicklung und Clearing | Sicherheitstyp | Qualität der Sicherheit** | Sicherheitenwährung | Fälligkeitsprofil*   | Betrag in Währung des Teilfonds |
|------------------------|-----------------------|-------------------------|----------------|---------------------------|---------------------|----------------------|---------------------------------|
| BNP Paribas            | Frankreich            | Dreiparteisicherheits   | Staatsanleihe  | A+                        | JPY                 | Mehr als ein Jahr    | 164.999                         |
| BNP Paribas            | Frankreich            | Dreiparteisicherheits   | Staatsanleihe  | A+                        | JPY                 | Weniger als ein Jahr | 151.097                         |

#### Multi-Asset Style Factors

| Sicherheitenkontrahent | Land des Kontrahenten | Abwicklung und Clearing | Sicherheitstyp | Qualität der Sicherheit** | Sicherheitenwährung | Fälligkeitsprofil* | Betrag in Währung des Teilfonds |
|------------------------|-----------------------|-------------------------|----------------|---------------------------|---------------------|--------------------|---------------------------------|
| BNP Paribas            | Frankreich            | Dreiparteisicherheits   | Aktien         | N/C                       | EUR                 | N/C                | 17.462.520                      |
| BNP Paribas            | Frankreich            | Dreiparteisicherheits   | Aktien         | N/C                       | USD                 | N/C                | 60.185.733                      |

# Anhang VII (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte („SFT-Verordnung“) (Fortsetzung)

## Aggregierte Transaktionsdaten (Fortsetzung)

### Wertpapierleihgeschäfte (Fortsetzung)

| Managed Solutions – Asia Focused Income |                        |                         |   |                           |                     |                      |                                    |
|---|------------------------|-------------------------|---|---------------------------|---------------------|----------------------|------------------------------------|
| Sicherheitenkontrahent                  | Land des Kontrahenten  | Abwicklung und Clearing | Sicherheitentyp                                 | Qualität der Sicherheit** | Sicherheitenwährung | Fälligkeitsprofil*   | Beträge (in Währung des Teilfonds) |
| Barclays Bank Plc                       | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe                                   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 2.233                              |
| Barclays Bank Plc                       | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 506                                |
| Barclays Bank Plc                       | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 207.917                            |
| Barclays Bank Plc                       | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Barmittel, die vom Kontrahenten gehalten werden | N/C                       | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 1.119.489                          |
| HSBC Bank PLC London                    | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Aktien  | N/C                       | EUR                 | N/C                  | 294.557                            |
| HSBC Bank PLC London                    | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Aktien  | N/C                       | GBP                 | N/C                  | 739.104                            |
| HSBC Bank PLC London                    | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 425                                |
| Nomura International Plc                | Japan                  | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Mehr als ein Jahr    | 3.039.404                          |
| Nomura International Plc                | Japan                  | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Weniger als ein Jahr | 379.477                            |
| UBS AG                                  | Schweiz                | Dreiparteisicherheiten  | Aktien  | N/C                       | USD                 | N/C                  | 132                                |
| UBS AG                                  | Schweiz                | Dreiparteisicherheiten  | Aktien  | N/C                       | JPY                 | N/C                  | 1.286.065                          |
| J.P. Morgan Chase Bank, New York        | USA                    | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe                                   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 75.643                             |
| J.P. Morgan Chase Bank, New York        | USA                    | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 175.533                            |
| J.P. Morgan Chase Bank, New York        | USA                    | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe                                   | AAA                       | CAD                 | Mehr als ein Jahr    | 175.374                            |
| J.P. Morgan Chase Bank, New York        | USA                    | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 312.317                            |
| J.P. Morgan Chase Bank, New York        | USA                    | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 140.630                            |
| Merrill Lynch International Bank London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Aktien  | N/C                       | USD                 | N/C                  | 164.119                            |
| Merrill Lynch International Bank London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe                                   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 716.398                            |
| Merrill Lynch International Bank London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 866.315                            |
| Merrill Lynch International Bank London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 170.208                            |
| Merrill Lynch International Bank London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 1.493.690                          |
| Merrill Lynch International Bank London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe                                   | AA+                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 431.259                            |
| Merrill Lynch International Bank London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe                                   | AA+                       | EUR                 | Weniger als ein Jahr | 2.210                              |
| Merrill Lynch International Bank London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Anleihe   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 489.565                            |
| Goldman Sachs International, London     | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Mehr als ein Jahr    | 231.993                            |
| BNP Paribas                             | Frankreich             | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Mehr als ein Jahr    | 1.567.291                          |
| BNP Paribas                             | Frankreich             | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Weniger als ein Jahr | 1.445.506                          |
| Barclays Bank, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe                                   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 704                                |
| Barclays Bank, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 798                                |
| Barclays Bank, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Mehr als ein Jahr    | 2.154                              |
| Barclays Bank, London                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Weniger als ein Jahr | 331                                |
| Morgan Stanley, London                  | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 525.443                            |
| Morgan Stanley, London                  | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe                                   | AA                        | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 88                                 |
| Morgan Stanley, London                  | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Mehr als ein Jahr    | 1.697.945                          |
| Morgan Stanley, London                  | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Weniger als ein Jahr | 423.319                            |

| US Income Focused                   |                        |                         |   |                           |                     |                      |                                    |
|-------------------------------------|------------------------|-------------------------|---|---------------------------|---------------------|----------------------|------------------------------------|
| Sicherheitenkontrahent              | Land des Kontrahenten  | Abwicklung und Clearing | Sicherheitentyp                                 | Qualität der Sicherheit** | Sicherheitenwährung | Fälligkeitsprofil*   | Beträge (in Währung des Teilfonds) |
| Barclays Bank Plc                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe                                   | AAA                       | EUR                 | Mehr als ein Jahr    | 3.330                              |
| Barclays Bank Plc                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 552.255                            |
| Barclays Bank Plc                   | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Barmittel, die vom Kontrahenten gehalten werden | N/C                       | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 2.977.260                          |
| HSBC Bank PLC London                | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Aktien  | N/C                       | EUR                 | N/C                  | 502.629                            |
| HSBC Bank PLC London                | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Aktien  | N/C                       | GBP                 | N/C                  | 1.561.401                          |
| HSBC Bank PLC London                | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Aktien  | N/C                       | USD                 | N/C                  | 1.753.018                          |
| HSBC Bank PLC London                | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe                                   | AA                        | GBP                 | Mehr als ein Jahr    | 2.361                              |
| Goldman Sachs International, London | Vereinigtes Königreich | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe                                   | AAA                       | USD                 | Mehr als ein Jahr    | 10.517.399                         |
| BNP Paribas                         | Frankreich             | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Mehr als ein Jahr    | 1.102.225                          |
| BNP Paribas                         | Frankreich             | Dreiparteisicherheiten  | Staatsanleihe                                   | A+                        | JPY                 | Weniger als ein Jahr | 1.017.013                          |
| Natixis                             | Frankreich             | Dreiparteisicherheiten  | Aktien  | N/C                       | EUR                 | N/C                  | 536.553                            |
| Natixis                             | Frankreich             | Dreiparteisicherheiten  | Aktien  | N/C                       | GBP                 | N/C                  | 642.133                            |
| Natixis                             | Frankreich             | Dreiparteisicherheiten  | Aktien  | N/C                       | USD                 | N/C                  | 641.305                            |
| Natixis                             | Frankreich             | Dreiparteisicherheiten  | Aktien  | N/C                       | CHF                 | N/C                  | 320.861                            |

\* Die Kontrakte für die Wertpapierleihgeschäfte haben eine offene Laufzeit

\*\* S&P Long-term Issuer Rating

# Anhang VII (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte („SFT-Verordnung“) (Fortsetzung)

## Aggregierte Transaktionsdaten (Fortsetzung)

### Total Return Swap

Für Total Return Swap wurden keine unbaren Sicherheiten erhalten.

Die Laufzeit beträgt weniger als ein Jahr. Das Währungsprofil des Total Return Swaps zum Berichtszeitpunkt ist in der Aufstellung der Derivate, Swaps angegeben.

Das Gründungsland des Kontrahenten zum Total Return Swap ist Frankreich.

Alle in Total Return Swaps engagierten Teilfonds nutzen die bilaterale Abwicklung und das Clearing mit dem jeweiligen Kontrahenten.

### Wiederverwendung von Sicherheiten

Die Teilfonds verwenden Sicherheiten nicht weiter.

### Sicherheitenverwahrung

Alle im Rahmen von Wertpapierleihgeschäften erhaltenen Sicherheiten werden von der Depotbank Bank of New York Mellon, von Euroclear oder von JP Morgan verwahrt.

Der Fonds hat keine Vermögenswerte als Sicherheiten für die Wertpapierleihe hinterlegt.

### Rendite und Kosten

Die Renditen und Kosten aus Wertpapierleihgeschäften stellen sich wie folgt dar:

#### ASEAN Equity \*\*

| Return       | Währung | Betrag | %<br>Gesamtrendite |
|--------------|---------|--------|--------------------|
| An Teilfonds | USD     | 9.903  | 75 %               |
| An Dritte*   | USD     | 3.301  | 25 %               |

#### Asia Pacific ex Japan Equity High Dividend

| Return       | Währung | Betrag | %<br>Gesamtrendite |
|--------------|---------|--------|--------------------|
| An Teilfonds | USD     | 60.995 | 75 %               |
| An Dritte*   | USD     | 20.332 | 25 %               |

#### Euroland Growth

| Return       | Währung | Betrag | %<br>Gesamtrendite |
|--------------|---------|--------|--------------------|
| An Teilfonds | EUR     | 28.118 | 75 %               |
| An Dritte*   | EUR     | 9.373  | 25 %               |

#### Global Emerging Markets Equity

| Return       | Währung | Betrag | %<br>Gesamtrendite |
|--------------|---------|--------|--------------------|
| An Teilfonds | USD     | 90.498 | 75 %               |
| An Dritte*   | USD     | 30.166 | 25 %               |

#### Global Sustainable Long Term Dividend

| Return       | Währung | Betrag | %<br>Gesamtrendite |
|--------------|---------|--------|--------------------|
| An Teilfonds | USD     | 3.558  | 75 %               |
| An Dritte*   | USD     | 1.186  | 25 %               |

#### Global Real Estate Equity

| Return       | Währung | Betrag  | %<br>Gesamtrendite |
|--------------|---------|---------|--------------------|
| An Teilfonds | USD     | 148.639 | 75 %               |
| An Dritte*   | USD     | 49.546  | 25 %               |

#### Global Equity Volatility Focused

| Return       | Währung | Betrag  | %<br>Gesamtrendite |
|--------------|---------|---------|--------------------|
| An Teilfonds | USD     | 147.700 | 75 %               |
| An Dritte*   | USD     | 49.233  | 25 %               |

#### Indian Equity

| Return       | Währung | Betrag | %<br>Gesamtrendite |
|--------------|---------|--------|--------------------|
| An Teilfonds | USD     | 24.174 | 75 %               |
| An Dritte*   | USD     | 8.058  | 25 %               |

#### Asia ex Japan Equity

| Return       | Währung | Betrag | %<br>Gesamtrendite |
|--------------|---------|--------|--------------------|
| An Teilfonds | USD     | 25.859 | 75 %               |
| An Dritte*   | USD     | 8.619  | 25 %               |

#### Chinese Equity

| Return       | Währung | Betrag | %<br>Gesamtrendite |
|--------------|---------|--------|--------------------|
| An Teilfonds | USD     | 57.475 | 75 %               |
| An Dritte*   | USD     | 19.158 | 25 %               |

#### Euroland Value

| Return       | Währung | Betrag | %<br>Gesamtrendite |
|--------------|---------|--------|--------------------|
| An Teilfonds | EUR     | 36.216 | 75 %               |
| An Dritte*   | EUR     | 12.072 | 25 %               |

#### Global Lower Carbon Equity

| Return       | Währung | Betrag | %<br>Gesamtrendite |
|--------------|---------|--------|--------------------|
| An Teilfonds | USD     | 11.587 | 75 %               |
| An Dritte*   | USD     | 3.862  | 25 %               |

#### Hong Kong Equity

| Return       | Währung | Betrag | %<br>Gesamtrendite |
|--------------|---------|--------|--------------------|
| An Teilfonds | USD     | 12.229 | 75 %               |
| An Dritte*   | USD     | 4.076  | 25 %               |

#### BRIC Markets Equity

| Return       | Währung | Betrag | %<br>Gesamtrendite |
|--------------|---------|--------|--------------------|
| An Teilfonds | USD     | 1.508  | 75 %               |
| An Dritte*   | USD     | 503    | 25 %               |

#### Brazil Equity

| Return       | Währung | Betrag | %<br>Gesamtrendite |
|--------------|---------|--------|--------------------|
| An Teilfonds | USD     | 9      | 75 %               |
| An Dritte*   | USD     | 3      | 25 %               |

#### Turkey Equity

| Return       | Währung | Betrag | %<br>Gesamtrendite |
|--------------|---------|--------|--------------------|
| An Teilfonds | EUR     | 11.250 | 75 %               |
| An Dritte*   | EUR     | 3.750  | 25 %               |

#### Asia ex Japan Equity Smaller Companies

| Return       | Währung | Betrag  | %<br>Gesamtrendite |
|--------------|---------|---------|--------------------|
| An Teilfonds | USD     | 896.675 | 75 %               |
| An Dritte*   | USD     | 300.366 | 25 %               |

#### Euroland Equity Smaller Companies

| Return       | Währung | Betrag | %<br>Gesamtrendite |
|--------------|---------|--------|--------------------|
| An Teilfonds | EUR     | 31.159 | 75 %               |
| An Dritte*   | EUR     | 10.386 | 25 %               |

#### Europe Value

| Return       | Währung | Betrag | %<br>Gesamtrendite |
|--------------|---------|--------|--------------------|
| An Teilfonds | EUR     | 32.270 | 75 %               |
| An Dritte*   | EUR     | 10.757 | 25 %               |

#### Global Infrastructure Equity

| Return       | Währung | Betrag  | %<br>Gesamtrendite |
|--------------|---------|---------|--------------------|
| An Teilfonds | USD     | 108.774 | 75 %               |
| An Dritte*   | USD     | 36.258  | 25 %               |

#### BRIC Equity

| Return       | Währung | Betrag | %<br>Gesamtrendite |
|--------------|---------|--------|--------------------|
| An Teilfonds | USD     | 6.750  | 75 %               |
| An Dritte*   | USD     | 2.250  | 25 %               |

#### Frontier Markets

| Return       | Währung | Betrag | %<br>Gesamtrendite |
|--------------|---------|--------|--------------------|
| An Teilfonds | USD     | 637    | 75 %               |
| An Dritte*   | USD     | 212    | 25 %               |

#### Economic Scale US Equity

| Return       | Währung | Betrag  | %<br>Gesamtrendite |
|--------------|---------|---------|--------------------|
| An Teilfonds | USD     | 278.541 | 75 %               |
| An Dritte*   | USD     | 92.847  | 25 %               |

#### Asia Bond

| Return       | Währung | Betrag  | %<br>Gesamtrendite |
|--------------|---------|---------|--------------------|
| An Teilfonds | USD     | 605.188 | 75 %               |
| An Dritte*   | USD     | 201.729 | 25 %               |

\* Die Wertpapierleihstelle: Hong Kong & Shanghai Bank, Hongkong

\*\* Bis zum 31. Juli 2023 lautete der Name des Teilfonds „Thai Equity“.

# Anhang VII (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte („SFT-Verordnung“) (Fortsetzung)

## Rendite und Kosten (Fortsetzung)

| Asia High Yield Bond |         |           |                    |
|----------------------|---------|-----------|--------------------|
| Return               | Währung | Betrag    | %<br>Gesamtrendite |
| An Teilfonds         | USD     | 2.523.801 | 75 %               |
| An Dritte*           | USD     | 841.267   | 25 %               |

| Euro Bond    |         |        |                    |
|--------------|---------|--------|--------------------|
| Return       | Währung | Betrag | %<br>Gesamtrendite |
| An Teilfonds | EUR     | 19.135 | 75 %               |
| An Dritte*   | EUR     | 6.378  | 25 %               |

| Euro Bond Total Return |         |        |                    |
|------------------------|---------|--------|--------------------|
| Return                 | Währung | Betrag | %<br>Gesamtrendite |
| An Teilfonds           | EUR     | 15.740 | 75 %               |
| An Dritte*             | EUR     | 5.247  | 25 %               |

| Euro Credit Bond |         |        |                    |
|------------------|---------|--------|--------------------|
| Return           | Währung | Betrag | %<br>Gesamtrendite |
| An Teilfonds     | EUR     | 52.044 | 75 %               |
| An Dritte*       | EUR     | 17.348 | 25 %               |

| Euro High Yield Bond |         |         |                    |
|----------------------|---------|---------|--------------------|
| Return               | Währung | Betrag  | %<br>Gesamtrendite |
| An Teilfonds         | EUR     | 414.957 | 75 %               |
| An Dritte*           | EUR     | 138.319 | 25 %               |

| GEM Debt Total Return |         |        |                    |
|-----------------------|---------|--------|--------------------|
| Return                | Währung | Betrag | %<br>Gesamtrendite |
| An Teilfonds          | USD     | 6.296  | 75 %               |
| An Dritte*            | USD     | 2.099  | 25 %               |

| Global Bond Total Return |         |        |                    |
|--------------------------|---------|--------|--------------------|
| Return                   | Währung | Betrag | %<br>Gesamtrendite |
| An Teilfonds             | USD     | 27.216 | 75 %               |
| An Dritte*               | USD     | 9.072  | 25 %               |

| Global Corporate Bond |         |         |                    |
|-----------------------|---------|---------|--------------------|
| Return                | Währung | Betrag  | %<br>Gesamtrendite |
| An Teilfonds          | USD     | 610.459 | 75 %               |
| An Dritte*            | USD     | 203.486 | 25 %               |

| Global Emerging Markets Bond |         |         |                    |
|------------------------------|---------|---------|--------------------|
| Return                       | Währung | Betrag  | %<br>Gesamtrendite |
| An Teilfonds                 | USD     | 221.381 | 75 %               |
| An Dritte*                   | USD     | 73.794  | 25 %               |

| Global Emerging Markets Local Debt |         |         |                    |
|------------------------------------|---------|---------|--------------------|
| Return                             | Währung | Betrag  | %<br>Gesamtrendite |
| An Teilfonds                       | USD     | 216.546 | 75 %               |
| An Dritte*                         | USD     | 72.182  | 25 %               |

| Global Government Bond |         |         |                    |
|------------------------|---------|---------|--------------------|
| Return                 | Währung | Betrag  | %<br>Gesamtrendite |
| An Teilfonds           | USD     | 991.833 | 75 %               |
| An Dritte*             | USD     | 320.611 | 25 %               |

| Global High Income Bond |         |         |                    |
|-------------------------|---------|---------|--------------------|
| Return                  | Währung | Betrag  | %<br>Gesamtrendite |
| An Teilfonds            | USD     | 179.957 | 75 %               |
| An Dritte*              | USD     | 59.986  | 25 %               |

| Global High Yield Bond |         |         |                    |
|------------------------|---------|---------|--------------------|
| Return                 | Währung | Betrag  | %<br>Gesamtrendite |
| An Teilfonds           | USD     | 577.714 | 75 %               |
| An Dritte*             | USD     | 192.571 | 25 %               |

| Global Inflation Linked Bond |         |        |                    |
|------------------------------|---------|--------|--------------------|
| Return                       | Währung | Betrag | %<br>Gesamtrendite |
| An Teilfonds                 | USD     | 66.670 | 75 %               |
| An Dritte*                   | USD     | 22.223 | 25 %               |

| Global Investment Grade Securitised Credit Bond |         |        |                    |
|---|---------|--------|--------------------|
| Return  | Währung | Betrag | %<br>Gesamtrendite |
| An Teilfonds                                    | USD     | 176    | 75 %               |
| An Dritte*                                      | USD     | 59     | 25 %               |

| Global Short Duration Bond |         |         |                    |
|----------------------------|---------|---------|--------------------|
| Return                     | Währung | Betrag  | %<br>Gesamtrendite |
| An Teilfonds               | USD     | 216.546 | 75 %               |
| An Dritte*                 | USD     | 72.182  | 25 %               |

| RMB Fixed Income |         |        |                    |
|------------------|---------|--------|--------------------|
| Return           | Währung | Betrag | %<br>Gesamtrendite |
| An Teilfonds     | USD     | 44.294 | 75 %               |
| An Dritte*       | USD     | 14.765 | 25 %               |

| Singapore Dollar Income Bond |         |         |                    |
|------------------------------|---------|---------|--------------------|
| Return                       | Währung | Betrag  | %<br>Gesamtrendite |
| An Teilfonds                 | SGD     | 114.880 | 75 %               |
| An Dritte*                   | SGD     | 38.293  | 25 %               |

| Ultra Short Duration Bond |         |        |                    |
|---------------------------|---------|--------|--------------------|
| Return                    | Währung | Betrag | %<br>Gesamtrendite |
| An Teilfonds              | USD     | 344    | 75 %               |
| An Dritte*                | USD     | 115    | 25 %               |

| US Dollar Bond |         |        |                    |
|----------------|---------|--------|--------------------|
| Return         | Währung | Betrag | %<br>Gesamtrendite |
| An Teilfonds   | USD     | 6.386  | 75 %               |
| An Dritte*     | USD     | 2.129  | 25 %               |

| Global Credit Floating Rate Fixed Term Bond 2023 – 1<br>(geschlossen zum 5. Juli 2023) |         |        |                    |
|--|---------|--------|--------------------|
| Return   | Währung | Betrag | %<br>Gesamtrendite |
| An Teilfonds   | USD     | 16.286 | 75 %               |
| An Dritte*   | USD     | 5.429  | 25 %               |

| Global Credit Floating Rate Fixed Term Bond 2023 – 2<br>(geschlossen zum 29. Dezember 2023) |         |        |                    |
|---|---------|--------|--------------------|
| Return  | Währung | Betrag | %<br>Gesamtrendite |
| An Teilfonds  | USD     | 22.773 | 75 %               |
| An Dritte*  | USD     | 7.591  | 25 %               |

| US Short Duration High Yield Bond** |         |        |                    |
|-------------------------------------|---------|--------|--------------------|
| Return                              | Währung | Betrag | %<br>Gesamtrendite |
| An Teilfonds                        | USD     | 32.949 | 75 %               |
| An Dritte*                          | USD     | 10.983 | 25 %               |

| Global Emerging Markets Multi-Asset Income |         |        |                    |
|--|---------|--------|--------------------|
| Return                                     | Währung | Betrag | %<br>Gesamtrendite |
| An Teilfonds                               | USD     | 154    | 75 %               |
| An Dritte*                                 | USD     | 51     | 25 %               |

| Managed Solutions – Asia Focused Conservative |         |        |                    |
|---|---------|--------|--------------------|
| Return  | Währung | Betrag | %<br>Gesamtrendite |
| An Teilfonds                                  | USD     | 927    | 75 %               |
| An Dritte*                                    | USD     | 309    | 25 %               |

| Multi-Asset Style Factors |         |        |                    |
|---------------------------|---------|--------|--------------------|
| Return                    | Währung | Betrag | %<br>Gesamtrendite |
| An Teilfonds              | EUR     | 15.244 | 75 %               |
| An Dritte*                | EUR     | 5.081  | 25 %               |

| Managed Solutions – Asia Focused Growth |         |        |                    |
|---|---------|--------|--------------------|
| Return                                  | Währung | Betrag | %<br>Gesamtrendite |
| An Teilfonds                            | USD     | 220    | 75 %               |
| An Dritte*                              | USD     | 73     | 25 %               |

| Managed Solutions – Asia Focused Income |         |         |                    |
|---|---------|---------|--------------------|
| Return                                  | Währung | Betrag  | %<br>Gesamtrendite |
| An Teilfonds                            | USD     | 255.686 | 75 %               |
| An Dritte*                              | USD     | 85.229  | 25 %               |

| Multi-Strategy Target Return |         |        |                    |
|------------------------------|---------|--------|--------------------|
| Return                       | Währung | Betrag | %<br>Gesamtrendite |
| An Teilfonds                 | EUR     | 2.889  | 75 %               |
| An Dritte*                   | EUR     | 963    | 25 %               |

| US Income Focused |         |        |                    |
|-------------------|---------|--------|--------------------|
| Return            | Währung | Betrag | %<br>Gesamtrendite |
| An Teilfonds      | USD     | 22.370 | 75 %               |
| An Dritte*        | USD     | 7.457  | 25 %               |

\* Die Wertpapierleihstelle: Hong Kong & Shanghai Bank, Hongkong.

\*\* Bis zum 3. Juli 2023 lautete der Name des Teilfonds „Global Short Duration High Yield Bond“.

Alle Renditen und Kosten aus Total Return Swaps werden dem jeweiligen Teilfonds zugerechnet.

## Anhang VIII (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Veröffentlichung der Performancedaten für in der Schweiz vertriebene Teilfonds – Information für Schweizer Anleger

| Teilfonds                              | Anteilsklasse | Währung der<br>Anteilsklasse | Performance während des Kalenderjahres |           |          |
|--|---------------|------------------------------|--|-----------|----------|
|  |               |                              | 2023                                   | 2022      | 2021     |
| ASEAN Equity <sup>1</sup>              | AC            | USD                          | (8,49) %                               | (2,21) %  | 4,19 %   |
|  | AD            | USD                          | (8,49) %                               | (2,21) %  | 4,19 %   |
|  | EC            | USD                          | (8,94) %                               | (2,70) %  | 3,67 %   |
|  | IC            | USD                          | (7,71) %                               | (1,38) %  | 5,08 %   |
| Asia ex Japan Equity                   | AC            | USD                          | 0,11 %                                 | (27,20) % | (3,72) % |
|  | AC EUR        | EUR                          | (3,27) %                               | (22,43) % | 3,59 %   |
|  | ACO EUR       | EUR                          | (2,25) %                               | (29,48) % | (4,84) % |
|  | AD            | USD                          | 0,11 %                                 | (27,20) % | (3,72) % |
|  | ADO EUR       | EUR                          | (2,23) %                               | (29,49) % | (4,85) % |
|  | BC            | USD                          | 0,87 %                                 | (26,65) % | (3,00) % |
|  | BCO EUR       | EUR                          | (1,51) %                               | (28,96) % | (4,13) % |
|  | BD            | USD                          | 0,88 %                                 | (26,64) % | (2,99) % |
|  | BD GBP        | GBP                          | (4,82) %                               | (17,40) % | (2,11) % |
|  | EC            | USD                          | (0,39) %                               | (27,56) % | (4,20) % |
|  | ED            | USD                          | (0,39) %                               | (27,56) % | (4,20) % |
|  | IC            | USD                          | 0,96 %                                 | (26,58) % | (2,90) % |
|  | ID            | USD                          | 1,00 %                                 | (26,57) % | (2,89) % |
|  | J1C           | USD                          | 1,11 %                                 | (26,47) % | (2,75) % |
|  | ZC            | USD                          | 1,78 %                                 | (25,95) % | (2,06) % |
| ZD                                     | USD           | 1,82 %                       | (25,93) %                              | (2,05) %  |          |
| Asia ex Japan Equity Smaller Companies | AC            | USD                          | 17,36 %                                | (28,03) % | 14,87 %  |
|  | AC EUR        | EUR                          | 13,39 %                                | (23,31) % | 23,60 %  |
|  | AD            | USD                          | 17,36 %                                | (28,03) % | 14,87 %  |
|  | AD HKD        | HKD                          | 17,42 %                                | (27,95) % | 15,50 %  |
|  | BC            | USD                          | 18,25 %                                | (27,49) % | 15,73 %  |
|  | BC EUR        | EUR                          | 14,24 %                                | (22,74) % | 24,52 %  |
|  | BC GBP        | GBP                          | 11,57 %                                | (18,35) % | 16,80 %  |
|  | BD            | USD                          | 18,25 %                                | (27,49) % | 15,75 %  |
|  | BD GBP        | GBP                          | 11,58 %                                | (18,35) % | 16,81 %  |
|  | EC            | USD                          | 16,78 %                                | (28,39) % | 14,30 %  |
|  | IC            | USD                          | 18,36 %                                | (27,42) % | 15,85 %  |
|  | IC EUR        | EUR                          | 14,36 %                                | (22,66) % | 24,64 %  |
|  | ID            | USD                          | 18,37 %                                | (27,41) % | 15,86 %  |
|  | J1C           | USD                          | 18,54 %                                | (27,31) % | 16,03 %  |
|  | XC            | USD                          | 18,48 %                                | (27,32) % | 16,00 %  |
| XD                                     | USD           | 19,52 %                      | (26,67) %                              | 15,80 %   |          |
| ZC                                     | USD           | 19,29 %                      | (26,81) %                              | 16,82 %   |          |

Die frühere Wertentwicklung stellt keinen Hinweis auf die derzeitige oder künftige Wertentwicklung dar. Die Performancedaten berücksichtigen nicht die Provisionen für die Ausgabe und Rücknahme von Anteilen.

<sup>1</sup> Bis zum 31. Juli 2023 lautete der Name des Teilfonds „Thai Equity“.

## Anhang VIII (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Veröffentlichung der Performancedaten für in der Schweiz vertriebene Teilfonds – Information für Schweizer Anleger (Fortsetzung)

| Teilfonds                                  | Anteilsklasse | Währung der Anteilsklasse | Performance während des Kalenderjahres |           |           |
|--|---------------|---------------------------|--|-----------|-----------|
|  |               |                           | 2023                                   | 2022      | 2021      |
| Asia Pacific ex Japan Equity High Dividend | AC            | USD                       | 9,23 %                                 | (17,75) % | 3,49 %    |
|  | AM2           | USD                       | 9,21 %                                 | (17,74) % | 3,52 %    |
|  | AM2 HKD       | HKD                       | 9,26 %                                 | (17,65) % | 4,08 %    |
|  | AM30 RMB      | RMB                       | 6,06 %                                 | (17,77) % | 6,08 %    |
|  | AS            | USD                       | 9,23 %                                 | (17,75) % | 3,50 %    |
|  | BC EUR        | EUR                       | 6,32 %                                 | (11,70) % | 12,19 %   |
|  | BD EUR        | EUR                       | 6,36 %                                 | (11,66) % | 12,21 %   |
|  | BS GBP        | GBP                       | 3,82 %                                 | (6,68) %  | 5,25 %    |
|  | EC            | USD                       | 8,68 %                                 | (18,16) % | 2,97 %    |
|  | IC            | USD                       | 10,16 %                                | (17,04) % | 4,37 %    |
|  | IC EUR        | EUR                       | 6,42 %                                 | (11,61) % | 12,30 %   |
|  | S9S           | USD                       | 10,55 %                                | (16,76) % | 4,77 %    |
|  | S48M2 SGD*    | SGD                       | 3,58 %                                 | -         | -         |
|  | XC            | USD                       | 10,36 %                                | (16,92) % | 4,49 %    |
|  | XD            | USD                       | 10,37 %                                | (16,87) % | 4,53 %    |
|  | XD EUR        | EUR                       | 6,60 %                                 | (11,47) % | 12,47 %   |
|  | XM2           | USD                       | 10,29 %                                | (16,92) % | (0,91) %  |
|  | ZM2           | USD                       | 11,05 %                                | (16,16) % | -         |
| ZS   | USD           | 11,08 %                   | (16,35) %                              | 5,24 %    |           |
| China A-Shares Equity                      | AC            | USD                       | (4,54) %                               | (30,27) % | (7,70) %  |
|  | BC            | USD                       | (3,79) %                               | (29,75) % | (7,00) %  |
|  | BD            | USD                       | (3,81) %                               | (29,75) % | (7,00) %  |
|  | XC            | USD                       | (3,65) %                               | (29,61) % | (6,80) %  |
|  | XC EUR        | EUR                       | (6,86) %                               | (24,98) % | 0,30 %    |
|  | ZC            | USD                       | (3,00) %                               | (29,15) % | (6,21) %  |
| Chinese Equity                             | AC            | USD                       | (13,66) %                              | (24,36) % | (20,77) % |
|  | AC EUR        | EUR                       | (16,58) %                              | (19,40) % | (14,75) % |
|  | AC GBP        | GBP                       | (18,53) %                              | (14,83) % | (20,04) % |
|  | AC HKD        | HKD                       | (13,62) %                              | (24,27) % | (21,17) % |
|  | AD            | USD                       | (13,64) %                              | (24,36) % | (20,77) % |
|  | AD GBP        | GBP                       | (18,51) %                              | (14,82) % | (20,04) % |
|  | AD HKD        | HKD                       | (13,59) %                              | (24,27) % | (20,34) % |
|  | BC            | USD                       | (13,01) %                              | (23,79) % | (20,17) % |
|  | BC GBP        | GBP                       | (17,92) %                              | (14,18) % | (19,44) % |
|  | BD            | USD                       | (12,97) %                              | (23,78) % | (20,17) % |
|  | BD GBP        | GBP                       | (17,88) %                              | (14,18) % | (19,44) % |
|  | EC            | USD                       | (14,09) %                              | (24,73) % | (21,17) % |
|  | IC            | USD                       | (12,92) %                              | (23,71) % | (20,09) % |
|  | ID            | USD                       | (12,89) %                              | (23,70) % | (20,09) % |
|  | J1C*          | USD                       | (22,15) %                              | -         | -         |
|  | XC EUR*       | EUR                       | (2,26) %                               | -         | -         |
|  | ZC            | USD                       | (12,13) %                              | (23,01) % | (19,34) % |
| ZD   | USD           | (12,07) %                 | (22,99) %                              | (19,34) % |           |
| Euroland Equity Smaller Companies          | AC            | EUR                       | 5,94 %                                 | (23,52) % | 15,26 %   |
|  | ACH USD       | USD                       | 8,47 %                                 | (20,91) % | 16,29 %   |
|  | AD            | EUR                       | 5,96 %                                 | (23,52) % | 15,26 %   |
|  | BC            | EUR                       | 6,73 %                                 | (22,94) % | 16,12 %   |
|  | EC            | EUR                       | 5,42 %                                 | (23,90) % | 14,69 %   |
|  | IC            | EUR                       | 6,84 %                                 | (22,87) % | 16,24 %   |
|  | ID            | EUR                       | 6,87 %                                 | (22,90) % | 16,22 %   |
|  | XC            | EUR                       | 6,87 %                                 | (22,75) % | 16,49 %   |
|  | ZC            | EUR                       | 7,71 %                                 | (22,19) % | 17,26 %   |

Die frühere Wertentwicklung stellt keinen Hinweis auf die derzeitige oder künftige Wertentwicklung dar. Die Performancedaten berücksichtigen nicht die Provisionen für die Ausgabe und Rücknahme von Anteilen.

\* Die Fonds wurden während des Geschäftsjahres aufgelegt, weshalb die Performance-Daten nicht den vollständigen 12-Monats-Zeitraum betreffen.

## Anhang VIII (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Veröffentlichung der Performancedaten für in der Schweiz vertriebene Teilfonds – Information für Schweizer Anleger (Fortsetzung)

| Teilfonds                      | Anteilsklasse | Währung der Anteilsklasse | Performance während des Kalenderjahres |           |          |
|--------------------------------|---------------|---------------------------|--|-----------|----------|
|                                |               |                           | 2023                                   | 2022      | 2021     |
| Euroland Growth                | AC            | EUR                       | 17,99 %                                | (21,28) % | 19,98 %  |
|                                | BC            | EUR                       | 18,87 %                                | (20,68) % | 20,88 %  |
|                                | EC            | EUR                       | 17,40 %                                | (21,66) % | 19,38 %  |
|                                | IC            | EUR                       | 18,99 %                                | (20,60) % | 21,00 %  |
|                                | M1C           | EUR                       | 18,28 %                                | (21,07) % | 20,28 %  |
|                                | M1D           | EUR                       | 18,29 %                                | (21,08) % | 20,29 %  |
|                                | XC            | EUR                       | 19,19 %                                | (20,50) % | 21,19 %  |
|                                | ZC            | EUR                       | 20,03 %                                | (19,91) % | 22,08 %  |
| Euroland Value                 | AC            | EUR                       | 18,88 %                                | (7,92) %  | 22,50 %  |
|                                | ACH USD       | USD                       | 21,63 %                                | (4,99) %  | 10,30 %  |
|                                | AD            | EUR                       | 18,91 %                                | (7,93) %  | 22,51 %  |
|                                | ADH USD       | USD                       | 21,66 %                                | (4,98) %  | 23,52 %  |
|                                | BC            | EUR                       | 19,77 %                                | (7,22) %  | 23,43 %  |
|                                | BD*           | EUR                       | 6,38 %                                 | -         | -        |
|                                | EC            | EUR                       | 18,29 %                                | (8,38) %  | 21,89 %  |
|                                | ED            | EUR                       | 18,31 %                                | (8,38) %  | 21,89 %  |
|                                | IC            | EUR                       | 19,90 %                                | (7,14) %  | 23,55 %  |
|                                | XC            | EUR                       | 20,21 %                                | (6,88) %  | 23,89 %  |
|                                | ZC            | EUR                       | 20,93 %                                | (6,31) %  | 24,65 %  |
|                                | ZD            | EUR                       | 20,97 %                                | (6,34) %  | 24,67 %  |
| Europe Value                   | AC            | EUR                       | 17,59 %                                | (7,17) %  | 15,53 %  |
|                                | AD            | EUR                       | 17,62 %                                | (7,18) %  | 15,54 %  |
|                                | EC            | EUR                       | 17,01 %                                | (7,63) %  | 14,95 %  |
|                                | ED            | EUR                       | 17,03 %                                | (7,64) %  | 14,95 %  |
|                                | IC            | EUR                       | 18,59 %                                | (6,38) %  | 16,51 %  |
|                                | ID            | EUR                       | 18,63 %                                | (6,39) %  | 16,54 %  |
|                                | PD            | EUR                       | 18,21 %                                | (6,72) %  | 16,13 %  |
|                                | ZC            | EUR                       | 19,54 %                                | (5,62) %  | 17,43 %  |
|                                | ZD            | EUR                       | 19,60 %                                | (5,65) %  | 17,47 %  |
| Global Emerging Markets Equity | AC            | USD                       | 4,79 %                                 | (23,95) % | (5,82) % |
|                                | AC EUR        | EUR                       | 1,17 %                                 | (19,21) % | 2,24 %   |
|                                | AC GBP        | GBP                       | (0,92) %                               | (14,85) % | (5,03) % |
|                                | AD            | USD                       | 4,79 %                                 | (23,95) % | (5,82) % |
|                                | AD GBP        | GBP                       | (0,92) %                               | (14,85) % | (5,03) % |
|                                | BC            | USD                       | 5,57 %                                 | (23,38) % | (5,11) % |
|                                | BC GBP        | GBP                       | (0,18) %                               | (14,20) % | (4,32) % |
|                                | BD*           | USD                       | 2,90 %                                 | -         | -        |
|                                | BD GBP        | GBP                       | (0,17) %                               | (14,20) % | (4,31) % |
|                                | EC            | USD                       | 4,26 %                                 | (24,33) % | (6,29) % |
|                                | ED            | USD                       | 4,26 %                                 | (24,33) % | (6,29) % |
|                                | IC            | USD                       | 5,67 %                                 | (23,30) % | (5,02) % |
|                                | PC            | USD                       | 5,30 %                                 | (23,57) % | (5,35) % |
|                                | PD            | USD                       | 5,33 %                                 | (23,57) % | (5,34) % |
|                                | S1D           | USD                       | 5,91 %                                 | (23,14) % | (4,82) % |
|                                | XC            | USD                       | 5,87 %                                 | (23,15) % | (4,86) % |
|                                | XC EUR        | EUR                       | 2,25 %                                 | (13,39) % | -        |
|                                | ZC            | USD                       | 6,63 %                                 | (1,29) %  | -        |
| ZD                             | USD           | 6,64 %                    | (22,60) %                              | (4,14) %  |          |

Die frühere Wertentwicklung stellt keinen Hinweis auf die derzeitige oder künftige Wertentwicklung dar. Die Performancedaten berücksichtigen nicht die Provisionen für die Ausgabe und Rücknahme von Anteilen.

\* Die Fonds wurden während des Geschäftsjahres aufgelegt, weshalb die Performance-Daten nicht den vollständigen 12-Monats-Zeitraum betreffen.



## Anhang VIII (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Veröffentlichung der Performancedaten für in der Schweiz vertriebene Teilfonds – Information für Schweizer Anleger (Fortsetzung)

| Teilfonds                      | Anteilsklasse                        | Währung der Anteilsklasse | Performance während des Kalenderjahres |           |           |
|--------------------------------|--------------------------------------|---------------------------|--|-----------|-----------|
|                                |                                      |                           | 2023                                   | 2022      | 2021      |
| Global Equity Circular Economy | AC                                   | USD                       | 18,80 %                                | 7,36 %    | -         |
|                                | AC EUR                               | EUR                       | 14,77 %                                | 5,20 %    | -         |
|                                | IC                                   | USD                       | 19,81 %                                | 7,85 %    | -         |
|                                | XC                                   | USD                       | 20,06 %                                | 7,96 %    | -         |
|                                | ZC                                   | USD                       | 20,71 %                                | 8,28 %    | -         |
| Global Equity Climate Change   | AC                                   | USD                       | 11,95 %                                | (28,06) % | 7,01 %    |
|                                | AC EUR                               | EUR                       | 7,54 %                                 | (23,57) % | 2,62 %    |
|                                | AC GBP                               | GBP                       | 5,67 %                                 | (19,45) % | 7,43 %    |
|                                | ACH AUD                              | AUD                       | 9,10 %                                 | (30,35) % | 7,09 %    |
|                                | ACH EUR                              | EUR                       | 8,82 %                                 | (30,92) % | 6,91 %    |
|                                | ACH GBP                              | GBP                       | 10,44 %                                | (30,05) % | 7,19 %    |
|                                | ACH HKD                              | HKD                       | 10,85 %                                | (28,51) % | 7,56 %    |
|                                | ACH SGD                              | SGD                       | 9,75 %                                 | (28,93) % | 7,37 %    |
|                                | AD                                   | USD                       | 11,96 %                                | (28,06) % | 7,01 %    |
|                                | AD EUR                               | EUR                       | 7,52 %                                 | (10,23) % | -         |
|                                | BC GBP*                              | GBP                       | 8,13 %                                 | -         | -         |
|                                | EC                                   | USD                       | 11,40 %                                | (28,42) % | 6,48 %    |
|                                | IC                                   | USD                       | 12,90 %                                | (27,44) % | 7,93 %    |
|                                | IC GBP                               | GBP                       | 6,51 %                                 | (4,55) %  | -         |
|                                | ID GBP                               | GBP                       | 6,51 %                                 | (4,55) %  | -         |
|                                | JC                                   | USD                       | 13,31 %                                | (27,19) % | 11,54 %   |
|                                | XC                                   | USD                       | 13,15 %                                | (27,30) % | 8,44 %    |
|                                | ZQ1                                  | USD                       | 13,88 %                                | (26,79) % | 8,78 %    |
|                                | Global Equity Sustainable Healthcare | AC                        | USD                                    | 5,84 %    | (17,39) % |
| AC EUR                         |                                      | EUR                       | 2,26 %                                 | (11,98) % | 3,28 %    |
| AC HKD                         |                                      | HKD                       | 5,88 %                                 | (17,30) % | (3,85) %  |
| ACO AUD                        |                                      | AUD                       | 3,62 %                                 | (19,51) % | (2,32) %  |
| ACO EUR                        |                                      | EUR                       | 3,24 %                                 | (20,12) % | (2,48) %  |
| ACO GBP                        |                                      | GBP                       | 4,72 %                                 | (19,04) % | (2,25) %  |
| ACO SGD                        |                                      | SGD                       | 3,98 %                                 | (18,16) % | (2,07) %  |
| AD*                            |                                      | USD                       | 16,39 %                                | -         | -         |
| ADO GBP*                       |                                      | GBP                       | 23,34 %                                | -         | -         |
| BC                             |                                      | USD                       | 6,63 %                                 | (16,77) % | (5,81) %  |
| BCO GBP                        |                                      | GBP                       | 5,49 %                                 | (18,42) % | 5,92 %    |
| BD EUR                         |                                      | EUR                       | 3,02 %                                 | (11,32) % | 0,39 %    |
| BD GBP*                        |                                      | GBP                       | 14,27 %                                | -         | -         |
| IC                             |                                      | USD                       | 6,73 %                                 | (16,69) % | (1,58) %  |
| JD                             |                                      | USD                       | 7,00 %                                 | (7,59) %  | -         |
| JD EUR                         |                                      | EUR                       | 3,38 %                                 | (6,60) %  | -         |
| JD GBP                         |                                      | GBP                       | 0,97 %                                 | (0,20) %  | -         |
| XC EUR                         |                                      | EUR                       | 3,37 %                                 | (11,05) % | 2,20 %    |
| XD                             |                                      | USD                       | 6,96 %                                 | (16,50) % | 6,75 %    |
| ZC                             |                                      | USD                       | 16,03 %                                | (16,03) % | (1,26) %  |

Die frühere Wertentwicklung stellt keinen Hinweis auf die derzeitige oder künftige Wertentwicklung dar. Die Performancedaten berücksichtigen nicht die Provisionen für die Ausgabe und Rücknahme von Anteilen.

\* Die Fonds wurden während des Geschäftsjahres aufgelegt, weshalb die Performance-Daten nicht den vollständigen 12-Monats-Zeitraum betreffen.

## Anhang VIII (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Veröffentlichung der Performancedaten für in der Schweiz vertriebene Teilfonds – Information für Schweizer Anleger (Fortsetzung)

| Teilfonds                    | Anteilsklasse | Währung der Anteilsklasse | Performance während des Kalenderjahres |           |         |
|------------------------------|---------------|---------------------------|--|-----------|---------|
|                              |               |                           | 2023                                   | 2022      | 2021    |
| Global Infrastructure Equity | AC            | USD                       | 8,02 %                                 | (8,06) %  | -       |
|                              | AC EUR*       | EUR                       | 2,73 %                                 | -         | -       |
|                              | AD*           | USD                       | 2,86 %                                 | -         | -       |
|                              | AM2           | USD                       | 8,02 %                                 | 0,71 %    | -       |
|                              | AM2 HKD       | HKD                       | 8,07 %                                 | 1,50 %    | -       |
|                              | AM30 AUD      | AUD                       | 5,32 %                                 | 1,08 %    | -       |
|                              | AM30 EUR      | EUR                       | 5,03 %                                 | 1,00 %    | -       |
|                              | AM30 GBP      | GBP                       | 6,53 %                                 | 1,08 %    | -       |
|                              | AM30 RMB      | RMB                       | 4,83 %                                 | 0,14 %    | -       |
|                              | AMFLX         | USD                       | 8,01 %                                 | 13,95 %   | -       |
|                              | AMFLX HKD     | HKD                       | 8,06 %                                 | 1,51 %    | -       |
|                              | AMFLXO AUD    | AUD                       | 5,34 %                                 | 1,08 %    | -       |
|                              | AMFLXO EUR    | EUR                       | 5,07 %                                 | 1,01 %    | -       |
|                              | AMFLXO GBP    | GBP                       | 6,58 %                                 | 1,08 %    | -       |
|                              | AMFLXO RMB    | RMB                       | 4,73 %                                 | 0,14 %    | -       |
|                              | BC*           | USD                       | 4,76 %                                 | -         | -       |
|                              | BC GBP*       | GBP                       | (1,24) %                               | -         | -       |
|                              | BD*           | USD                       | 3,71 %                                 | -         | -       |
|                              | S46C*         | USD                       | 5,33 %                                 | -         | -       |
|                              | S46CO EUR*    | EUR                       | 3,25 %                                 | -         | -       |
| S46CO GBP                    | GBP           | 7,93 %                    | (2,65) %                               | -         |         |
| ZBFIX8.5 JPY                 | JPY           | 17,19 %                   | (4,78) %                               | -         |         |
| ZC*                          | USD           | 10,93 %                   | -                                      | -         |         |
| ZD                           | USD           | 9,91 %                    | (5,07) %                               | -         |         |
| ZQ1                          | USD           | 9,86 %                    | (3,70) %                               | -         |         |
| ZQ1 GBP                      | GBP           | 3,69 %                    | 1,31 %                                 | -         |         |
| Global Real Estate Equity    | AC            | USD                       | 7,30 %                                 | (27,55) % | 25,09 % |
|                              | AC EUR        | EUR                       | 3,06 %                                 | (23,03) % | 35,79 % |
|                              | AD            | USD                       | 7,31 %                                 | (27,56) % | 25,09 % |
|                              | AM2           | USD                       | 7,29 %                                 | (27,55) % | 27,11 % |
|                              | AM30 SGD      | SGD                       | 5,11 %                                 | (28,26) % | 24,70 % |
|                              | BQ1           | USD                       | 8,10 %                                 | (27,02) % | 31,32 % |
|                              | ID            | USD                       | 8,28 %                                 | (26,91) % | 26,22 % |
|                              | ZBFIX8.5 JPY  | JPY                       | 15,28 %                                | (14,76) % | 41,91 % |
|                              | ZC            | USD                       | 9,24 %                                 | (26,23) % | 27,35 % |
|                              | ZD            | USD                       | 9,24 %                                 | (26,27) % | 27,38 % |
|                              | ZM2           | USD                       | 9,18 %                                 | (26,24) % | 27,34 % |
|                              | ZQ1           | USD                       | 9,23 %                                 | (26,24) % | 27,37 % |

Die frühere Wertentwicklung stellt keinen Hinweis auf die derzeitige oder künftige Wertentwicklung dar. Die Performancedaten berücksichtigen nicht die Provisionen für die Ausgabe und Rücknahme von Anteilen.

\* Die Fonds wurden während des Geschäftsjahres aufgelegt, weshalb die Performance-Daten nicht den vollständigen 12-Monats-Zeitraum betreffen.

## Anhang VIII (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Veröffentlichung der Performancedaten für in der Schweiz vertriebene Teilfonds – Information für Schweizer Anleger (Fortsetzung)

| Teilfonds                             | Anteilsklasse | Währung der Anteilsklasse | Performance während des Kalenderjahres |           |           |
|---------------------------------------|---------------|---------------------------|--|-----------|-----------|
|                                       |               |                           | 2023                                   | 2022      | 2021      |
| Global Lower Carbon Equity            | AC            | USD                       | 20,38 %                                | (18,17) % | 20,22 %   |
|                                       | AC EUR        | EUR                       | 15,62 %                                | (13,07) % | 30,52 %   |
|                                       | AD            | USD                       | 20,39 %                                | (18,18) % | 20,23 %   |
|                                       | AD HKD        | HKD                       | 20,69 %                                | (18,24) % | 20,97 %   |
|                                       | BC            | USD                       | 20,86 %                                | (17,84) % | 20,71 %   |
|                                       | BC GBP        | GBP                       | 14,07 %                                | (8,00) %  | 21,72 %   |
|                                       | EC            | USD                       | 20,03 %                                | (18,41) % | 3,73 %    |
|                                       | ID            | USD                       | 21,01 %                                | (17,78) % | 20,84 %   |
|                                       | XC            | USD                       | 21,10 %                                | (17,68) % | 20,95 %   |
| ZQ1                                   | USD           | 21,60 %                   | (17,33) %                              | 21,39 %   |           |
| Global Sustainable Equity Income      | AD            | USD                       | 18,47 %                                | 3,10 %    | -         |
|                                       | ZBFIX8.5 JPY  | JPY                       | 27,24 %                                | (2,12) %  | -         |
|                                       | ZM1           | USD                       | 19,27 %                                | 10,06 %   | -         |
|                                       | ZQ1           | USD                       | 19,23 %                                | (5,69) %  | -         |
| Global Sustainable Long Term Dividend | AC            | USD                       | 22,30 %                                | (19,01) % | 17,14 %   |
|                                       | AC EUR        | EUR                       | 17,48 %                                | (13,98) % | 27,17 %   |
|                                       | AM2           | USD                       | 22,31 %                                | (19,02) % | 17,16 %   |
|                                       | AM2 HKD       | HKD                       | 22,61 %                                | (19,09) % | 17,88 %   |
|                                       | AMFLX         | USD                       | 22,34 %                                | 15,38 %   | -         |
|                                       | AQ2           | USD                       | 22,80 %                                | (19,02) % | 17,15 %   |
|                                       | EQ2           | USD                       | 21,69 %                                | (19,42) % | 16,56 %   |
|                                       | IC            | USD                       | 23,23 %                                | (18,44) % | 4,25 %    |
|                                       | IQ            | USD                       | 23,23 %                                | (18,43) % | 4,25 %    |
|                                       | XC            | USD                       | 23,59 %                                | (18,16) % | 18,38 %   |
| ZM2                                   | USD           | 24,27 %                   | (17,72) %                              | 19,04 %   |           |
| Global Sustainable Long Term Equity   | AC            | USD                       | 27,15 %                                | 2,97 %    | -         |
|                                       | AC GBP        | GBP                       | 19,97 %                                | (3,51) %  | -         |
|                                       | AD            | USD                       | 27,14 %                                | 2,97 %    | -         |
|                                       | BC            | USD                       | 28,11 %                                | 3,22 %    | -         |
|                                       | BD            | USD                       | 28,10 %                                | 3,22 %    | -         |
|                                       | IC            | USD                       | 28,23 %                                | 3,25 %    | -         |
|                                       | ID            | USD                       | 28,23 %                                | 3,25 %    | -         |
|                                       | ZC            | USD                       | 29,20 %                                | 3,50 %    | -         |
|                                       | ZQ1*          | USD                       | 6,43 %                                 | -         | -         |
| Hong Kong Equity                      | AC            | USD                       | (16,55) %                              | (16,02) % | (17,43) % |
|                                       | AC HKD        | HKD                       | (16,52) %                              | (15,92) % | (19,43) % |
|                                       | AD            | USD                       | (16,54) %                              | (16,02) % | (17,43) % |
|                                       | AD HKD        | HKD                       | (16,50) %                              | (15,92) % | (16,98) % |
|                                       | BD GBP        | GBP                       | (20,64) %                              | (4,71) %  | (16,03) % |
|                                       | EC            | USD                       | (16,97) %                              | (16,43) % | (17,85) % |
|                                       | IC            | USD                       | (15,84) %                              | (15,30) % | (16,73) % |
|                                       | PD            | USD                       | (16,11) %                              | (15,59) % | (17,01) % |
|                                       | ZD            | USD                       | (15,12) %                              | (14,62) % | (16,04) % |

Die frühere Wertentwicklung stellt keinen Hinweis auf die derzeitige oder künftige Wertentwicklung dar. Die Performancedaten berücksichtigen nicht die Provisionen für die Ausgabe und Rücknahme von Anteilen.

\* Die Fonds wurden während des Geschäftsjahres aufgelegt, weshalb die Performance-Daten nicht den vollständigen 12-Monats-Zeitraum betreffen.

## Anhang VIII (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Veröffentlichung der Performancedaten für in der Schweiz vertriebene Teilfonds – Information für Schweizer Anleger (Fortsetzung)

| Teilfonds                        | Anteilsklasse | Währung der Anteilsklasse | Performance während des Kalenderjahres |           |          |
|----------------------------------|---------------|---------------------------|--|-----------|----------|
|                                  |               |                           | 2023                                   | 2022      | 2021     |
| BRIC Equity                      | AC            | USD                       | 5,78 %                                 | (29,12) % | (6,31) % |
|                                  | AC GBP        | GBP                       | (0,15) %                               | (20,63) % | (5,53) % |
|                                  | AC HKD        | HKD                       | 6,04 %                                 | (29,18) % | (5,72) % |
|                                  | AD            | USD                       | 5,82 %                                 | (29,12) % | (6,30) % |
|                                  | AD GBP        | GBP                       | (0,12) %                               | (20,64) % | (5,52) % |
|                                  | BC GBP        | GBP                       | 0,59 %                                 | (20,04) % | (4,81) % |
|                                  | BD GBP        | GBP                       | 0,63 %                                 | (20,04) % | (4,79) % |
|                                  | EC            | USD                       | 5,26 %                                 | (29,47) % | (6,78) % |
|                                  | IC            | USD                       | 6,68 %                                 | (28,51) % | (5,51) % |
|                                  | IC EUR        | EUR                       | 2,47 %                                 | (24,06) % | 2,58 %   |
|                                  | L1C           | USD                       | 6,91 %                                 | (28,35) % | (5,26) % |
|                                  | M1C           | USD                       | 6,31 %                                 | (28,76) % | (5,84) % |
|                                  | M2C           | USD                       | 6,31 %                                 | (28,76) % | (5,84) % |
|                                  | M2D           | USD                       | 6,35 %                                 | (28,77) % | (5,83) % |
| BRIC Markets Equity              | AC            | USD                       | 5,53 %                                 | (28,76) % | (6,29) % |
|                                  | AD            | USD                       | 5,56 %                                 | (28,76) % | (6,29) % |
|                                  | BD            | USD                       | 6,37 %                                 | (28,23) % | (5,57) % |
|                                  | EC            | USD                       | 5,01 %                                 | (29,12) % | (6,76) % |
|                                  | IC            | USD                       | 6,42 %                                 | (28,15) % | (5,49) % |
|                                  | J1C           | USD                       | 6,58 %                                 | (28,05) % | (5,35) % |
| Frontier Markets                 | AC            | USD                       | 27,81 %                                | (8,53) %  | 36,27 %  |
|                                  | AC EUR        | EUR                       | 22,76 %                                | (2,84) %  | 47,93 %  |
|                                  | AD            | USD                       | 27,82 %                                | (8,53) %  | 36,27 %  |
|                                  | AD EUR        | EUR                       | 22,76 %                                | (2,83) %  | 48,48 %  |
|                                  | BC            | USD                       | 28,45 %                                | (8,07) %  | 36,94 %  |
|                                  | BC GBP        | GBP                       | 21,24 %                                | 2,93 %    | 38,11 %  |
|                                  | EC            | USD                       | 27,17 %                                | (8,99) %  | 35,58 %  |
|                                  | EC EUR        | EUR                       | 22,15 %                                | (3,32) %  | 47,20 %  |
|                                  | IC            | USD                       | 28,58 %                                | (7,99) %  | 37,08 %  |
|                                  | IC EUR        | EUR                       | 23,49 %                                | (2,25) %  | 48,82 %  |
|                                  | ID            | USD                       | 28,59 %                                | (7,97) %  | 37,09 %  |
|                                  | XC            | USD                       | 29,03 %                                | (7,62) %  | 37,58 %  |
|                                  | XD            | USD                       | 29,05 %                                | (7,60) %  | 37,60 %  |
|                                  | ZC            | USD                       | 29,44 %                                | (6,70) %  | 31,31 %  |
| ZD                               | USD           | 30,30 %                   | (6,68) %                               | 38,97 %   |          |
| Global Equity Volatility Focused | AC            | USD                       | 14,84 %                                | (12,10) % | 12,35 %  |
|                                  | AC EUR        | EUR                       | 10,31 %                                | (6,63) %  | 21,96 %  |
|                                  | ACO AUD       | AUD                       | 12,42 %                                | (14,03) % | 11,38 %  |
|                                  | ACO EUR       | EUR                       | 11,98 %                                | (14,87) % | 11,08 %  |
|                                  | ACO SGD       | SGD                       | 12,80 %                                | (12,79) % | 12,00 %  |
|                                  | AM2           | USD                       | 14,84 %                                | (12,11) % | 12,35 %  |
|                                  | AM2 HKD       | HKD                       | 15,13 %                                | (12,18) % | 13,04 %  |
|                                  | AM3O AUD      | AUD                       | 12,41 %                                | (14,05) % | 11,37 %  |
|                                  | AM3O CAD      | CAD                       | 13,79 %                                | (13,06) % | 11,71 %  |
|                                  | AM3O EUR      | EUR                       | 11,97 %                                | (14,87) % | 11,06 %  |
|                                  | AM3O RMB      | RMB                       | 11,58 %                                | (11,96) % | 15,08 %  |
|                                  | AM3O SGD      | SGD                       | 12,80 %                                | (12,79) % | 12,01 %  |
|                                  | BC            | USD                       | 15,30 %                                | (11,75) % | 12,95 %  |
|                                  | BC GBP        | GBP                       | 8,83 %                                 | (1,19) %  | 13,90 %  |
|                                  | EC            | USD                       | 14,50 %                                | (12,36) % | 11,92 %  |

Die frühere Wertentwicklung stellt keinen Hinweis auf die derzeitige oder künftige Wertentwicklung dar. Die Performancedaten berücksichtigen nicht die Provisionen für die Ausgabe und Rücknahme von Anteilen.

## Anhang VIII (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Veröffentlichung der Performancedaten für in der Schweiz vertriebene Teilfonds – Information für Schweizer Anleger (Fortsetzung)

| Teilfonds                | Anteilsklasse | Währung der Anteilsklasse | Performance während des Kalenderjahres |           |           |
|--------------------------|---------------|---------------------------|--|-----------|-----------|
|                          |               |                           | 2023                                   | 2022      | 2021      |
| Brazil Equity            | AC            | USD                       | 26,03 %                                | 5,48 %    | (28,70) % |
|                          | AC EUR        | EUR                       | 21,04 %                                | 12,04 %   | (22,59) % |
|                          | AC GBP        | GBP                       | 18,95 %                                | 18,12 %   | (28,11) % |
|                          | AD            | USD                       | 26,16 %                                | 5,46 %    | (28,70) % |
|                          | AD GBP        | GBP                       | 19,10 %                                | 18,06 %   | (28,10) % |
|                          | AD HKD        | HKD                       | 26,49 %                                | 5,38 %    | (28,26) % |
|                          | BC            | USD                       | 27,12 %                                | 6,40 %    | (28,07) % |
|                          | BC GBP        | GBP                       | 20,01 %                                | 19,14 %   | (27,47) % |
|                          | BD            | USD                       | 27,31 %                                | 6,37 %    | (28,07) % |
|                          | BD GBP        | GBP                       | 20,14 %                                | 19,12 %   | (27,46) % |
|                          | EC            | USD                       | 25,40 %                                | 4,95 %    | (29,06) % |
|                          | ED            | USD                       | 25,59 %                                | 4,96 %    | (29,07) % |
|                          | IC            | USD                       | 27,26 %                                | 6,51 %    | (27,99) % |
|                          | ID            | USD                       | 27,42 %                                | 6,48 %    | (27,99) % |
|                          | J1C*          | USD                       | 24,05 %                                | -         | -         |
|                          | S3D           | USD                       | 27,85 %                                | 6,83 %    | (27,75) % |
|                          | XC            | USD                       | 27,61 %                                | 6,77 %    | (27,79) % |
| ZC                       | USD           | 28,49 %                   | 7,52 %                                 | (27,28) % |           |
| Economic Scale US Equity | AC            | USD                       | 17,56 %                                | (12,63) % | 30,67 %   |
|                          | ACH EUR       | EUR                       | 14,47 %                                | (15,66) % | 29,14 %   |
|                          | AD            | USD                       | 17,57 %                                | (12,63) % | 30,68 %   |
|                          | ADH EUR       | EUR                       | 14,48 %                                | (15,67) % | 29,15 %   |
|                          | BC            | USD                       | 17,91 %                                | (12,36) % | 31,06 %   |
|                          | BC GBP        | GBP                       | 11,30 %                                | (1,87) %  | 32,16 %   |
|                          | BCH EUR*      | EUR                       | 51,74 %                                | -         | -         |
|                          | BD            | USD                       | 17,93 %                                | (12,37) % | 31,08 %   |
|                          | BD GBP        | GBP                       | 11,31 %                                | (1,88) %  | 32,17 %   |
|                          | EC            | USD                       | 17,21 %                                | (12,89) % | 30,28 %   |
|                          | ECH EUR       | EUR                       | 14,12 %                                | (15,91) % | 28,75 %   |
|                          | IC            | USD                       | 18,03 %                                | (12,28) % | 31,19 %   |
|                          | ICH EUR       | EUR                       | 14,96 %                                | (15,31) % | 29,69 %   |
|                          | ID            | USD                       | 18,04 %                                | (12,28) % | 31,20 %   |
|                          | PD            | USD                       | 17,81 %                                | (12,46) % | 30,94 %   |
|                          | XD            | USD                       | 18,10 %                                | (12,24) % | 31,27 %   |
|                          | YD            | USD                       | 18,22 %                                | (12,15) % | 31,40 %   |
| ZC                       | USD           | 18,51 %                   | (11,90) %                              | 31,75 %   |           |
| ZD                       | USD           | 18,41 %                   | (12,02) %                              | 31,69 %   |           |

Die frühere Wertentwicklung stellt keinen Hinweis auf die derzeitige oder künftige Wertentwicklung dar. Die Performancedaten berücksichtigen nicht die Provisionen für die Ausgabe und Rücknahme von Anteilen.

\* Die Fonds wurden während des Geschäftsjahres aufgelegt, weshalb die Performance-Daten nicht den vollständigen 12-Monats-Zeitraum betreffen.

## Anhang VIII (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Veröffentlichung der Performancedaten für in der Schweiz vertriebene Teilfonds – Information für Schweizer Anleger (Fortsetzung)

| Teilfonds       | Anteilsklasse | Währung der Anteilsklasse | Performance während des Kalenderjahres |           |           |
|-----------------|---------------|---------------------------|--|-----------|-----------|
|                 |               |                           | 2023                                   | 2022      | 2021      |
| Indian Equity   | AC            | USD                       | 20,28 %                                | (10,75) % | 28,12 %   |
|                 | AC CHF        | CHF                       | 9,41 %                                 | (9,37) %  | 32,07 %   |
|                 | AC EUR        | EUR                       | 16,21 %                                | (4,90) %  | 37,85 %   |
|                 | AC GBP        | GBP                       | 13,49 %                                | 0,50 %    | 29,31 %   |
|                 | AD            | USD                       | 20,28 %                                | (10,75) % | 28,12 %   |
|                 | AD EUR        | EUR                       | 16,21 %                                | (4,90) %  | 37,85 %   |
|                 | AD GBP        | GBP                       | 13,50 %                                | 0,50 %    | 29,31 %   |
|                 | AD HKD        | HKD                       | 20,32 %                                | (10,65) % | 28,82 %   |
|                 | BC            | USD                       | 21,18 %                                | (10,07) % | 29,09 %   |
|                 | BC GBP        | GBP                       | 14,35 %                                | 1,25 %    | 30,28 %   |
|                 | BD            | USD                       | 21,18 %                                | (10,08) % | 29,09 %   |
|                 | BD GBP        | GBP                       | 14,34 %                                | 1,25 %    | 30,27 %   |
|                 | EC            | USD                       | 19,68 %                                | (11,19) % | 27,49 %   |
|                 | ED            | USD                       | 19,68 %                                | (11,19) % | 27,49 %   |
|                 | FC            | USD                       | 21,91 %                                | (9,52) %  | (2,71) %  |
|                 | IC            | USD                       | 21,30 %                                | (9,99) %  | 29,22 %   |
|                 | IC EUR        | EUR                       | 17,19 %                                | (4,09) %  | 39,03 %   |
|                 | ID            | USD                       | 21,30 %                                | (9,99) %  | 29,22 %   |
|                 | J1C*          | USD                       | 21,75 %                                | -         | -         |
|                 | XD            | USD                       | 21,48 %                                | (9,81) %  | 29,60 %   |
| ZC              | USD           | 22,38 %                   | (9,19) %                               | 30,36 %   |           |
| ZD              | USD           | 22,38 %                   | (9,19) %                               | 30,38 %   |           |
| Russia Equity** | AC            | USD                       | -                                      | -         | 17,83 %   |
|                 | AC EUR        | EUR                       | -                                      | -         | 27,91 %   |
|                 | AC GBP        | GBP                       | -                                      | -         | 18,82 %   |
|                 | AD            | USD                       | -                                      | -         | 17,85 %   |
|                 | AD GBP        | GBP                       | -                                      | -         | 18,84 %   |
|                 | AD HKD        | HKD                       | -                                      | -         | 18,58 %   |
|                 | BC            | USD                       | -                                      | -         | 18,86 %   |
|                 | BC GBP        | GBP                       | -                                      | -         | 19,86 %   |
|                 | EC            | USD                       | -                                      | -         | 17,25 %   |
|                 | IC            | USD                       | -                                      | -         | 18,98 %   |
|                 | ZC            | USD                       | -                                      | -         | 20,09 %   |
| Turkey Equity   | AC            | EUR                       | 2,79 %                                 | 147,91 %  | (15,38) % |
|                 | AC GBP        | GBP                       | 0,39 %                                 | 161,97 %  | (20,62) % |
|                 | AD            | EUR                       | 2,81 %                                 | 147,87 %  | (15,37) % |
|                 | AD GBP        | GBP                       | 0,41 %                                 | 161,96 %  | (20,63) % |
|                 | BC            | EUR                       | 3,68 %                                 | 150,07 %  | (14,63) % |
|                 | BC GBP        | GBP                       | 1,26 %                                 | 164,27 %  | (19,93) % |
|                 | BD            | EUR                       | 3,72 %                                 | 149,99 %  | (14,61) % |
|                 | BD GBP        | GBP                       | 1,30 %                                 | 164,23 %  | (19,91) % |
|                 | EC            | EUR                       | 2,28 %                                 | 146,68 %  | (15,80) % |
|                 | IC            | EUR                       | 3,79 %                                 | 150,32 %  | (14,55) % |

Die frühere Wertentwicklung stellt keinen Hinweis auf die derzeitige oder künftige Wertentwicklung dar. Die Performancedaten berücksichtigen nicht die Provisionen für die Ausgabe und Rücknahme von Anteilen.

\* Die Fonds wurden während des Geschäftsjahres aufgelegt, weshalb die Performance-Daten nicht den vollständigen 12-Monats-Zeitraum betreffen.

\*\* Der Handel und die Berechnung des Nettoinventarwerts des Teilfonds Russia Equity sind seit 25. Februar 2022 aufgrund der Schließung der Moskauer Börse ausgesetzt. Ein indikativer Nettoinventarwert zum 31. März 2024 wurde lediglich zu Darstellungszwecken im Jahresabschluss errechnet. Der Ausschuss für die Preisbestimmung und die Verwaltungsgesellschaft haben vereinbart und veranlasst, dass alle auf Rubel lautenden russischen Aktien im Anlageportfolio auf null abgeschrieben werden.

## Anhang VIII (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Veröffentlichung der Performancedaten für in der Schweiz vertriebene Teilfonds – Information für Schweizer Anleger (Fortsetzung)

| Teilfonds | Anteilsklasse | Währung der Anteilsklasse | Performance während des Kalenderjahres |           |           |
|-----------|---------------|---------------------------|--|-----------|-----------|
|           |               |                           | 2023                                   | 2022      | 2021      |
| Asia Bond | AC            | USD                       | 5,07 %                                 | (16,08) % | (4,20) %  |
|           | ACH EUR       | EUR                       | 2,75 %                                 | (17,92) % | (2,09) %  |
|           | AM2           | USD                       | 5,08 %                                 | (16,08) % | 0,49 %    |
|           | AM3H SGD      | SGD                       | 3,41 %                                 | (16,34) % | (4,33) %  |
|           | BC            | USD                       | 5,67 %                                 | (15,62) % | (3,67) %  |
|           | FC            | USD                       | 6,13 %                                 | (15,21) % | 0,11 %    |
|           | FDH EUR       | EUR                       | 3,76 %                                 | (17,09) % | 0,64 %    |
|           | IC            | USD                       | 5,72 %                                 | (15,53) % | (3,59) %  |
|           | ICH EUR       | EUR                       | 3,37 %                                 | (17,43) % | (4,50) %  |
|           | IDH EUR       | EUR                       | 3,19 %                                 | (17,42) % | (4,52) %  |
|           | XDH EUR       | EUR                       | 3,54 %                                 | (17,26) % | (4,32) %  |
|           | ZDH EUR       | EUR                       | 4,07 %                                 | (16,86) % | (3,81) %  |
|           | ZQ1           | USD                       | 6,36 %                                 | (15,00) % | (3,01) %  |
|           | ZQ1H AUD      | AUD                       | 4,56 %                                 | (15,79) % | (2,24) %  |
|           | ZQ1H CHF      | CHF                       | 2,02 %                                 | (17,21) % | (2,66) %  |
|           | ZQ1H EUR      | EUR                       | 4,02 %                                 | (16,90) % | (2,21) %  |
|           | ZQ1H GBP      | GBP                       | 5,60 %                                 | (15,62) % | (3,18) %  |
|           | ZQ1H SGD      | SGD                       | 4,68 %                                 | (15,27) % | (1,58) %  |
|           | S47M3H SGD*   | SGD                       | 2,71 %                                 | -         | -         |
|           | Asia ESG Bond | AC                        | USD                                    | 4,42 %    | (12,82) % |
| ACO CHF   |               | CHF                       | 0,20 %                                 | (15,00) % | -         |
| ACO EUR   |               | EUR                       | 2,27 %                                 | (14,68) % | -         |
| ACO GBP   |               | GBP                       | 3,77 %                                 | (13,50) % | -         |
| ACO HKD   |               | HKD                       | 3,34 %                                 | (13,26) % | -         |
| ACO RMB   |               | RMB                       | 1,70 %                                 | (12,52) % | -         |
| ACO SGD   |               | SGD                       | 2,78 %                                 | (13,07) % | -         |
| AM2       |               | USD                       | 4,49 %                                 | (12,82) % | -         |
| AM2 HKD   |               | HKD                       | 4,55 %                                 | (12,66) % | -         |
| AM3O AUD  |               | AUD                       | 2,91 %                                 | (13,53) % | -         |
| AM3O EUR  |               | EUR                       | 2,26 %                                 | (14,68) % | -         |
| AM3O GBP  |               | GBP                       | 3,71 %                                 | (13,51) % | -         |
| AM3O HKD  |               | HKD                       | 3,35 %                                 | (13,26) % | -         |
| AM3O RMB  |               | RMB                       | 1,68 %                                 | (12,52) % | -         |
| AM3O SGD  |               | SGD                       | 2,87 %                                 | (13,07) % | -         |
| IC        |               | USD                       | 5,20 %                                 | (12,23) % | -         |
| ICO CHF   |               | CHF                       | 0,89 %                                 | (14,47) % | -         |
| ICO EUR   |               | EUR                       | 2,81 %                                 | (14,14) % | -         |
| ICO GBP   |               | GBP                       | 4,31 %                                 | (12,94) % | -         |
| ICO HKD   |               | HKD                       | 4,12 %                                 | (12,68) % | -         |
| ICO RMB   |               | RMB                       | 2,27 %                                 | (11,96) % | -         |
| ICO SGD   |               | SGD                       | 3,52 %                                 | (12,51) % | -         |
| XC        |               | USD                       | 5,46 %                                 | (12,07) % | -         |
| XCO CHF   |               | CHF                       | 1,17 %                                 | (14,26) % | -         |
| XCO EUR   |               | EUR                       | 3,15 %                                 | (13,95) % | -         |
| XCO GBP   |               | GBP                       | 4,65 %                                 | (12,77) % | -         |
| XCO HKD   |               | HKD                       | 4,41 %                                 | (12,50) % | -         |
| XCO RMB   |               | RMB                       | 2,59 %                                 | (11,75) % | -         |
| XCO SGD   |               | SGD                       | 3,72 %                                 | (12,33) % | -         |
| ZC        |               | USD                       | 5,78 %                                 | (11,39) % | -         |

Die frühere Wertentwicklung stellt keinen Hinweis auf die derzeitige oder künftige Wertentwicklung dar. Die Performancedaten berücksichtigen nicht die Provisionen für die Ausgabe und Rücknahme von Anteilen.

\* Die Fonds wurden während des Geschäftsjahres aufgelegt, weshalb die Performance-Daten nicht den vollständigen 12-Monats-Zeitraum betreffen.

## Anhang VIII (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Veröffentlichung der Performancedaten für in der Schweiz vertriebene Teilfonds – Information für Schweizer Anleger (Fortsetzung)

| Teilfonds             | Anteilsklasse | Währung der Anteilsklasse | Performance während des Kalenderjahres |           |           |
|-----------------------|---------------|---------------------------|--|-----------|-----------|
|                       |               |                           | 2023                                   | 2022      | 2021      |
| Asia High Yield Bond  | AC            | USD                       | (6,51) %                               | (21,55) % | (15,35) % |
|                       | ACH CHF       | CHF                       | (10,24) %                              | (23,65) % | (10,35) % |
|                       | ACH EUR       | EUR                       | (8,54) %                               | (23,35) % | (9,56) %  |
|                       | ADH EUR       | EUR                       | (8,56) %                               | (23,34) % | 3,72 %    |
|                       | AM            | USD                       | (6,52) %                               | (21,56) % | (15,34) % |
|                       | AM2           | USD                       | (6,54) %                               | (21,56) % | (15,33) % |
|                       | AM2 HKD       | HKD                       | (6,49) %                               | (21,46) % | (14,87) % |
|                       | AM3H AUD      | AUD                       | (8,04) %                               | (22,28) % | (15,73) % |
|                       | AM3H SGD      | SGD                       | (8,02) %                               | (21,85) % | (15,45) % |
|                       | BC            | USD                       | (5,91) %                               | (21,07) % | (14,81) % |
|                       | BD            | USD                       | (5,93) %                               | (21,00) % | (15,08) % |
|                       | BDH CHF       | CHF                       | (9,74) %                               | (23,14) % | (13,03) % |
|                       | BDH EUR       | EUR                       | (7,97) %                               | (22,85) % | (15,76) % |
|                       | IC            | USD                       | (5,84) %                               | (20,98) % | (14,73) % |
|                       | IM2           | USD                       | (5,85) %                               | (20,99) % | (14,74) % |
|                       | IM3H SGD      | SGD                       | (7,33) %                               | (21,29) % | (15,07) % |
|                       | PCH SGD       | SGD                       | (7,75) %                               | (21,66) % | (15,24) % |
|                       | PM2           | USD                       | (6,30) %                               | (21,35) % | (15,13) % |
|                       | PM3H AUD      | AUD                       | (7,84) %                               | (22,09) % | (15,52) % |
|                       | PM3H EUR      | EUR                       | (8,34) %                               | (23,15) % | (15,94) % |
|                       | PM3H SGD      | SGD                       | (7,78) %                               | (21,66) % | (15,25) % |
|                       | S40C          | USD                       | (5,62) %                               | (11,90) % | -         |
|                       | S40M2         | USD                       | (5,62) %                               | (11,89) % | -         |
|                       | XC            | USD                       | (5,68) %                               | (20,85) % | (14,57) % |
|                       | XCH CHF       | CHF                       | (9,50) %                               | (23,57) % | (15,85) % |
|                       | XCH EUR       | EUR                       | (7,76) %                               | (22,70) % | (15,32) % |
|                       | XD            | USD                       | (5,70) %                               | (20,79) % | (14,59) % |
|                       | ZBFIX8.5H JPY | JPY                       | (10,46) %                              | (22,33) % | (14,90) % |
|                       | ZC            | USD                       | (5,11) %                               | (20,37) % | (14,07) % |
|                       | ZCH EUR       | EUR                       | (7,22) %                               | (22,24) % | (14,38) % |
|                       | ZQ1           | USD                       | (5,11) %                               | (20,40) % | (14,06) % |
|                       | ZQ1H AUD      | AUD                       | (6,82) %                               | (21,24) % | (14,59) % |
| ZQ1H CHF              | CHF           | (8,96) %                  | (22,54) %                              | (15,02) % |           |
| ZQ1H EUR              | EUR           | (7,21) %                  | (22,25) %                              | (14,90) % |           |
| ZQ1H GBP              | GBP           | (5,84) %                  | (20,97) %                              | (14,33) % |           |
| ZQ1H JPY              | JPY           | (10,36) %                 | (22,17) %                              | (14,47) % |           |
| ZQ1H SGD              | SGD           | (6,69) %                  | (20,72) %                              | (14,20) % |           |
| Asian Currencies Bond | AC            | USD                       | 4,18 %                                 | (9,54) %  | (10,12) % |
|                       | AC EUR        | EUR                       | 0,07 %                                 | (3,91) %  | (2,43) %  |
|                       | AD            | USD                       | 4,17 %                                 | (9,54) %  | (10,11) % |
|                       | EC            | USD                       | 3,88 %                                 | (9,82) %  | (10,39) % |
|                       | IC            | USD                       | 4,94 %                                 | (8,89) %  | (9,47) %  |
|                       | ID EUR        | EUR                       | 0,74 %                                 | (3,23) %  | (1,69) %  |
|                       | ZD            | USD                       | 5,58 %                                 | (8,32) %  | (8,88) %  |
| Brazil Bond           | AC            | USD                       | 26,10 %                                | 13,20 %   | (13,28) % |
|                       | AD            | USD                       | 26,16 %                                | 13,24 %   | (13,26) % |
|                       | BC            | USD                       | 26,73 %                                | 13,77 %   | (12,84) % |
|                       | BD GBP*       | GBP                       | 17,37 %                                | -         | -         |
|                       | EC            | USD                       | 25,72 %                                | 12,87 %   | (13,54) % |
|                       | ED            | USD                       | 25,77 %                                | 12,90 %   | (13,52) % |
|                       | IC            | USD                       | 26,85 %                                | 13,88 %   | (12,75) % |
|                       | ZD            | USD                       | 27,56 %                                | 14,49 %   | (12,30) % |

Die frühere Wertentwicklung stellt keinen Hinweis auf die derzeitige oder künftige Wertentwicklung dar. Die Performancedaten berücksichtigen nicht die Provisionen für die Ausgabe und Rücknahme von Anteilen.

\* Die Fonds wurden während des Geschäftsjahres aufgelegt, weshalb die Performance-Daten nicht den vollständigen 12-Monats-Zeitraum betreffen.



## Anhang VIII (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Veröffentlichung der Performancedaten für in der Schweiz vertriebene Teilfonds – Information für Schweizer Anleger (Fortsetzung)

| Teilfonds  | Anteilsklasse | Währung der Anteilsklasse | Performance während des Kalenderjahres |           |          |
|--|---------------|---------------------------|--|-----------|----------|
|  |               |                           | 2023                                   | 2022      | 2021     |
| Corporate Euro Bond Fixed Term 2027<br>(aufgelegt zum 30. Juni 2023) | AC*           | EUR                       | 5,58 %                                 | -         | -        |
|  | AD*           | EUR                       | 5,52 %                                 | -         | -        |
|  | BC*           | EUR                       | 5,74 %                                 | -         | -        |
|  | BCH USD*      | USD                       | 6,72 %                                 | -         | -        |
|  | BD*           | EUR                       | 5,74 %                                 | -         | -        |
|  | BD3H USD*     | USD                       | 5,37 %                                 | -         | -        |
|  | EC*           | EUR                       | 5,43 %                                 | -         | -        |
|  | ED*           | EUR                       | 5,41 %                                 | -         | -        |
|  | IC*           | EUR                       | 5,70 %                                 | -         | -        |
| ZC*  | EUR           | 4,32 %                    | -                                      | -         |          |
| Euro Bond  | AC            | EUR                       | 6,45 %                                 | (17,32) % | (3,64) % |
|  | AD            | EUR                       | 6,46 %                                 | (17,32) % | (3,65) % |
|  | EC            | EUR                       | 6,14 %                                 | (17,56) % | (3,94) % |
|  | IC            | EUR                       | 6,97 %                                 | (16,93) % | (3,19) % |
|  | ID            | EUR                       | 6,96 %                                 | (16,93) % | (3,18) % |
|  | S18C          | EUR                       | 7,20 %                                 | (16,74) % | (2,97) % |
|  | XCH JPY       | JPY                       | 3,07 %                                 | (17,29) % | (2,74) % |
|  | ZC            | EUR                       | 7,35 %                                 | (16,61) % | (2,80) % |
| Euro Bond Total Return   | AC            | EUR                       | 5,13 %                                 | (6,80) %  | (0,83) % |
|  | AD            | EUR                       | 5,13 %                                 | (6,79) %  | (0,83) % |
|  | BC            | EUR                       | 5,61 %                                 | (6,38) %  | (0,37) % |
|  | EC            | EUR                       | 4,81 %                                 | (7,07) %  | (1,14) % |
|  | IC            | EUR                       | 5,66 %                                 | (6,33) %  | (0,34) % |
|  | ID            | EUR                       | 5,65 %                                 | (6,33) %  | (0,34) % |
|  | ZC            | EUR                       | 6,16 %                                 | (5,84) %  | 0,18 %   |
| Euro Credit Bond   | AC            | EUR                       | 6,50 %                                 | (14,11) % | (1,72) % |
|  | AD            | EUR                       | 6,50 %                                 | (14,10) % | (1,71) % |
|  | BC            | EUR                       | 6,95 %                                 | (13,73) % | (1,30) % |
|  | EC            | EUR                       | 6,19 %                                 | (14,36) % | (2,01) % |
|  | IC            | EUR                       | 7,01 %                                 | (13,70) % | (1,25) % |
|  | ID            | EUR                       | 7,00 %                                 | (13,69) % | (1,24) % |
|  | S19C          | EUR                       | 7,26 %                                 | (13,50) % | (1,02) % |
|  | XC            | EUR                       | 7,18 %                                 | (13,57) % | (1,04) % |
|  | XD            | EUR                       | 7,17 %                                 | (13,55) % | (1,09) % |
| ZC   | EUR           | 7,54 %                    | (13,26) %                              | (0,74) %  |          |

Die frühere Wertentwicklung stellt keinen Hinweis auf die derzeitige oder künftige Wertentwicklung dar. Die Performancedaten berücksichtigen nicht die Provisionen für die Ausgabe und Rücknahme.

## Anhang VIII (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Veröffentlichung der Performancedaten für in der Schweiz vertriebene Teilfonds – Information für Schweizer Anleger (Fortsetzung)

| Teilfonds                      | Anteilsklasse | Währung der Anteilsklasse | Performance während des Kalenderjahres |           |          |
|--------------------------------|---------------|---------------------------|--|-----------|----------|
|                                |               |                           | 2023                                   | 2022      | 2021     |
| Euro High Yield Bond           | AC            | EUR                       | 7,31 %                                 | (11,08) % | 0,92 %   |
|                                | ACH USD       | USD                       | 9,50 %                                 | (9,10) %  | 1,73 %   |
|                                | AD            | EUR                       | 7,30 %                                 | (11,08) % | 0,92 %   |
|                                | AM2           | EUR                       | 7,31 %                                 | (11,08) % | 0,92 %   |
|                                | BC            | EUR                       | 7,89 %                                 | (10,59) % | 1,48 %   |
|                                | BD            | EUR                       | 7,89 %                                 | (10,59) % | 1,47 %   |
|                                | EC            | EUR                       | 6,99 %                                 | (11,34) % | 0,62 %   |
|                                | ED            | EUR                       | 6,99 %                                 | (11,34) % | 0,62 %   |
|                                | IC            | EUR                       | 7,95 %                                 | (10,54) % | 1,53 %   |
|                                | ICH CHF       | CHF                       | 5,71 %                                 | (10,98) % | 1,26 %   |
|                                | ICH USD       | USD                       | 10,17 %                                | (14,30) % | 2,34 %   |
|                                | ID            | EUR                       | 7,95 %                                 | (10,54) % | 1,53 %   |
|                                | S8C           | EUR                       | 8,22 %                                 | (10,32) % | 1,78 %   |
|                                | S8D           | EUR                       | 8,22 %                                 | (10,32) % | 1,79 %   |
|                                | XC            | EUR                       | 8,09 %                                 | (10,42) % | 1,69 %   |
|                                | XD            | EUR                       | 8,10 %                                 | (10,41) % | 1,68 %   |
|                                | ZC            | EUR                       | 8,64 %                                 | (9,96) %  | 2,19 %   |
| ZQ1                            | EUR           | 8,64 %                    | (9,96) %                               | 1,69 %    |          |
| ESG Short Duration Credit Bond | AC*           | USD                       | 5,25 %                                 | -         | -        |
|                                | AM2*          | USD                       | 5,25 %                                 | -         | -        |
|                                | AM2H SGD*     | SGD                       | 3,65 %                                 | -         | -        |
|                                | AM3H AUD      | AUD                       | 3,75 %                                 | -         | -        |
|                                | AM3H EUR*     | EUR                       | 3,20 %                                 | -         | -        |
|                                | AM3H GBP*     | GBP                       | 4,57 %                                 | -         | -        |
|                                | BC*           | USD                       | 5,61 %                                 | -         | -        |
|                                | BCH EUR*      | EUR                       | 3,59 %                                 | -         | -        |
|                                | BCH GBP*      | GBP                       | 4,96 %                                 | -         | -        |
|                                | BM2*          | USD                       | 5,61 %                                 | -         | -        |
|                                | BM3H CHF*     | CHF                       | 1,62 %                                 | -         | -        |
|                                | BM3H EUR*     | EUR                       | 3,54 %                                 | -         | -        |
|                                | BM3H GBP*     | GBP                       | 4,95 %                                 | -         | -        |
|                                | ZQ1*          | USD                       | 6,06 %                                 | -         | -        |
| ZQ1H CHF*                      | CHF           | 2,10 %                    | -                                      | -         |          |
| ZQ1H EUR*                      | EUR           | 4,02 %                    | -                                      | -         |          |
| ZQ1H GBP*                      | GBP           | 5,39 %                    | -                                      | -         |          |
| GEM Debt Total Return          | BC            | USD                       | 11,83 %                                | (17,30) % | (1,82) % |
|                                | BCH EUR       | EUR                       | 9,24 %                                 | (19,47) % | (2,81) % |
|                                | FC            | USD                       | 12,36 %                                | (16,86) % | (1,16) % |
|                                | L1C           | USD                       | 12,28 %                                | (16,96) % | (1,43) % |
|                                | L1C EUR       | EUR                       | 8,48 %                                 | (11,52) % | 6,05 %   |
|                                | L1CH CHF      | CHF                       | 7,60 %                                 | (19,29) % | (2,56) % |
|                                | L1CH EUR      | EUR                       | 9,68 %                                 | (19,15) % | (2,42) % |
|                                | L1D           | USD                       | 12,29 %                                | (16,94) % | (1,42) % |
|                                | L1DH EUR      | EUR                       | 9,67 %                                 | (19,15) % | (2,41) % |
|                                | M1C           | USD                       | 11,61 %                                | (17,46) % | (2,02) % |
|                                | M1C EUR       | EUR                       | 7,82 %                                 | (12,05) % | 5,42 %   |
|                                | M1CH EUR      | EUR                       | 9,02 %                                 | (19,64) % | (2,99) % |
|                                | M1D           | USD                       | 11,62 %                                | (17,44) % | (2,01) % |
|                                | M1D EUR       | EUR                       | 7,81 %                                 | (12,05) % | 5,44 %   |
|                                | M1DH EUR      | EUR                       | 9,04 %                                 | (19,64) % | (2,96) % |
| N1C                            | USD           | 12,17 %                   | (17,05) %                              | (1,53) %  |          |
| N1CH EUR                       | EUR           | 9,57 %                    | (19,23) %                              | (2,51) %  |          |
| N1DH EUR                       | EUR           | 9,55 %                    | (19,23) %                              | (2,51) %  |          |

Die frühere Wertentwicklung stellt keinen Hinweis auf die derzeitige oder künftige Wertentwicklung dar. Die Performancedaten berücksichtigen nicht die Provisionen für die Ausgabe und Rücknahme von Anteilen.

\* Die Fonds wurden während des Geschäftsjahres aufgelegt, weshalb die Performance-Daten nicht den vollständigen 12-Monats-Zeitraum betreffen.

## Anhang VIII (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Veröffentlichung der Performancedaten für in der Schweiz vertriebene Teilfonds – Information für Schweizer Anleger (Fortsetzung)

| Teilfonds                | Anteilsklasse | Währung der Anteilsklasse | Performance während des Kalenderjahres |           |          |
|--------------------------|---------------|---------------------------|--|-----------|----------|
|                          |               |                           | 2023                                   | 2022      | 2021     |
| Global Bond              | AC            | USD                       | 4,46 %                                 | (16,28) % | (5,46) % |
|                          | AD            | USD                       | 4,46 %                                 | (16,28) % | (5,45) % |
|                          | AM2*          | USD                       | 7,37 %                                 | -         | -        |
|                          | AM2 HKD       | HKD                       | 4,72 %                                 | (16,34) % | (4,87) % |
|                          | EC            | USD                       | 4,16 %                                 | (16,54) % | (5,73) % |
|                          | IC            | USD                       | 4,96 %                                 | (15,88) % | (5,01) % |
|                          | PD            | USD                       | 4,73 %                                 | (16,07) % | (5,22) % |
|                          | WC GBP        | GBP                       | (0,41) %                               | (5,32) %  | (3,70) % |
|                          | ZD            | USD                       | 5,35 %                                 | (15,57) % | (4,65) % |
| Global Bond Total Return | AC            | USD                       | 4,69 %                                 | (12,24) % | 0,03 %   |
|                          | BC            | USD                       | 5,17 %                                 | (11,84) % | (0,54) % |
|                          | BCH GBP       | GBP                       | 4,21 %                                 | (12,35) % | (0,90) % |
|                          | IC            | USD                       | 5,22 %                                 | (11,80) % | 0,52 %   |
|                          | ICH EUR       | EUR                       | 2,89 %                                 | (13,61) % | (0,43) % |
|                          | ICH GBP       | GBP                       | 4,35 %                                 | (12,29) % | 0,24 %   |
|                          | IQ1H EUR      | EUR                       | 2,90 %                                 | (13,58) % | (0,43) % |
|                          | IQ1H GBP      | GBP                       | 4,41 %                                 | (12,30) % | 0,21 %   |
|                          | S15CH GBP     | GBP                       | 4,92 %                                 | (11,87) % | (0,78) % |
|                          | WCH GBP       | GBP                       | 5,07 %                                 | (11,71) % | 0,90 %   |
|                          | XC            | USD                       | 5,34 %                                 | (11,71) % | 0,61 %   |
|                          | XCH EUR       | EUR                       | 3,10 %                                 | (13,42) % | (0,29) % |
|                          | XCH GBP       | GBP                       | 4,49 %                                 | (12,18) % | 0,30 %   |
|                          | XQ1H GBP      | GBP                       | 4,63 %                                 | (12,12) % | 0,26 %   |
|                          | ZC            | USD                       | 5,75 %                                 | (11,32) % | 0,99 %   |
|                          | ZQ1           | USD                       | 5,75 %                                 | (11,33) % | 0,55 %   |
| ZQ1H GBP                 | GBP           | 4,91 %                    | (11,80) %                              | (0,48) %  |          |
| Global Corporate Bond    | BC            | USD                       | 9,21 %                                 | (14,41) % | (0,87) % |
|                          | BCH EUR       | EUR                       | 6,81 %                                 | 0,95 %    | -        |
|                          | BQ1H GBP      | GBP                       | 8,34 %                                 | (15,16) % | (1,24) % |
|                          | ICH EUR       | EUR                       | 6,84 %                                 | (16,32) % | (1,78) % |
|                          | ZC            | USD                       | 9,77 %                                 | (13,98) % | (0,42) % |
|                          | ZCH EUR       | EUR                       | 7,34 %                                 | (15,92) % | (1,30) % |
|                          | ZD            | USD                       | 9,77 %                                 | (13,96) % | (0,36) % |
|                          | ZDH GBP       | GBP                       | 8,82 %                                 | (14,79) % | (0,68) % |
|                          | ZQ1           | USD                       | 9,79 %                                 | (13,97) % | (0,34) % |
|                          | ZQ1H AUD      | AUD                       | 7,98 %                                 | (14,84) % | (0,70) % |
|                          | ZQ1H CHF      | CHF                       | 5,14 %                                 | (16,36) % | (1,57) % |
|                          | ZQ1H EUR      | EUR                       | 7,33 %                                 | (15,91) % | (1,32) % |
|                          | ZQ1H GBP      | GBP                       | 8,91 %                                 | (14,70) % | (0,60) % |
|                          | ZQ1H SGD      | SGD                       | 8,01 %                                 | (14,27) % | (0,46) % |

Die frühere Wertentwicklung stellt keinen Hinweis auf die derzeitige oder künftige Wertentwicklung dar. Die Performancedaten berücksichtigen nicht die Provisionen für die Ausgabe und Rücknahme von Anteilen.

\* Die Fonds wurden während des Geschäftsjahres aufgelegt, weshalb die Performance-Daten nicht den vollständigen 12-Monats-Zeitraum betreffen.

## Anhang VIII (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Veröffentlichung der Performancedaten für in der Schweiz vertriebene Teilfonds – Information für Schweizer Anleger (Fortsetzung)

| Teilfonds  | Anteilsklasse | Währung der Anteilsklasse | Performance während des Kalenderjahres |           |          |
|--|---------------|---------------------------|--|-----------|----------|
|  |               |                           | 2023                                   | 2022      | 2021     |
| Global Emerging Markets Bond                       | AC            | USD                       | 10,12 %                                | (21,34) % | (3,57) % |
|  | AC EUR        | EUR                       | 6,40 %                                 | (16,19) % | 3,76 %   |
|  | AC GBP        | GBP                       | 3,91 %                                 | (11,44) % | (2,68) % |
|  | AC HKD        | HKD                       | 10,18 %                                | (21,26) % | (3,05) % |
|  | ACH CHF       | CHF                       | 6,13 %                                 | (23,20) % | (4,72) % |
|  | ACH EUR       | EUR                       | 7,62 %                                 | (23,55) % | (4,57) % |
|  | AD            | USD                       | 10,12 %                                | (21,33) % | (3,57) % |
|  | AD GBP        | GBP                       | 3,91 %                                 | (11,42) % | (2,68) % |
|  | ADH EUR       | EUR                       | 7,61 %                                 | (23,51) % | (4,55) % |
|  | AM2           | USD                       | 10,12 %                                | (21,36) % | (3,56) % |
|  | AM2 HKD       | HKD                       | 10,18 %                                | (21,27) % | (3,05) % |
|  | AM3H AUD      | AUD                       | 8,23 %                                 | (22,45) % | (4,01) % |
|  | AM3H EUR      | EUR                       | 7,61 %                                 | (23,52) % | (4,54) % |
|  | AM3H SGD      | SGD                       | 8,29 %                                 | (21,80) % | (3,72) % |
|  | BC            | USD                       | 10,82 %                                | (20,85) % | (2,97) % |
|  | BC GBP        | GBP                       | 4,56 %                                 | (10,88) % | (2,07) % |
|  | BCH EUR       | EUR                       | 8,29 %                                 | (23,04) % | (3,96) % |
|  | BD GBP        | GBP                       | 4,56 %                                 | (10,86) % | (2,07) % |
|  | BQ1H GBP      | GBP                       | 9,86 %                                 | (8,02) %  | (7,53) % |
|  | EC            | USD                       | 9,79 %                                 | (21,58) % | (3,86) % |
|  | ECH EUR       | EUR                       | 7,30 %                                 | (23,74) % | (4,83) % |
|  | ED            | USD                       | 9,79 %                                 | (21,57) % | (3,86) % |
|  | IC            | USD                       | 11,06 %                                | (20,67) % | (2,75) % |
|  | IC EUR        | EUR                       | 7,29 %                                 | (15,47) % | 4,64 %   |
|  | ICH CHF       | CHF                       | 6,44 %                                 | (23,00) % | (3,91) % |
|  | ICH EUR       | EUR                       | 8,53 %                                 | (22,86) % | (3,75) % |
|  | ID EUR        | EUR                       | 7,26 %                                 | (15,47) % | 4,66 %   |
|  | IDH EUR       | EUR                       | 8,50 %                                 | (22,86) % | (3,75) % |
|  | FC EUR*       | EUR                       | 6,48 %                                 | -         | -        |
|  | PC            | USD                       | 10,40 %                                | (21,15) % | (3,33) % |
|  | PD            | USD                       | 10,39 %                                | (21,13) % | (3,33) % |
|  | XC            | USD                       | 11,21 %                                | (20,56) % | (2,61) % |
|  | XDH EUR       | EUR                       | 8,67 %                                 | (22,77) % | (3,47) % |
|  | ZC            | USD                       | 11,77 %                                | (20,17) % | (2,13) % |
|  | ZCH EUR       | EUR                       | 9,20 %                                 | (22,39) % | (3,12) % |
|  | ZD            | USD                       | 11,76 %                                | (20,14) % | (2,12) % |
| ZQ1  | USD           | 11,78 %                   | (20,16) %                              | (2,13) %  |          |
| ZQ1H AUD   | AUD           | 9,78 %                    | (21,35) %                              | (2,67) %  |          |
| ZQ1H CHF   | CHF           | 7,05 %                    | (22,58) %                              | (3,37) %  |          |
| ZQ1H EUR   | EUR           | 9,18 %                    | (22,36) %                              | (3,16) %  |          |
| ZQ1H GBP   | GBP           | 10,80 %                   | (21,16) %                              | (2,44) %  |          |
| ZQ1H SGD   | SGD           | 9,90 %                    | (20,63) %                              | (2,31) %  |          |
| Global Emerging Markets Corporate Sustainable Bond | AC            | USD                       | 6,52 %                                 | 5,64 %    | -        |
|  | ACH EUR*      | EUR                       | 4,27 %                                 | -         | -        |
|  | AD            | USD                       | 6,52 %                                 | 5,64 %    | -        |
|  | IC            | USD                       | 7,28 %                                 | 5,84 %    | -        |
|  | ID            | USD                       | 7,29 %                                 | 5,84 %    | -        |
|  | XC            | USD                       | 7,51 %                                 | 5,89 %    | -        |
| ZQ1  | USD           | 8,04 %                    | 6,01 %                                 | -         |          |

Die frühere Wertentwicklung stellt keinen Hinweis auf die derzeitige oder künftige Wertentwicklung dar. Die Performancedaten berücksichtigen nicht die Provisionen für die Ausgabe und Rücknahme von Anteilen.

\* Die Fonds wurden während des Geschäftsjahres aufgelegt, weshalb die Performance-Daten nicht den vollständigen 12-Monats-Zeitraum betreffen.

## Anhang VIII (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Veröffentlichung der Performancedaten für in der Schweiz vertriebene Teilfonds – Information für Schweizer Anleger (Fortsetzung)

| Teilfonds                              | Anteilsklasse | Währung der Anteilsklasse | Performance während des Kalenderjahres |           |           |
|--|---------------|---------------------------|--|-----------|-----------|
|  |               |                           | 2023                                   | 2022      | 2021      |
| Global Emerging Markets ESG Bond       | AC*           | USD                       | (8,70) %                               | -         | -         |
|  | XC*           | USD                       | (6,75) %                               | -         | -         |
|  | ZQ1           | USD                       | 11,54 %                                | -         | -         |
|  | ZCH EUR*      | EUR                       | 5,21 %                                 | -         | -         |
|  | ZQ1H GBP*     | GBP                       | (3,69) %                               | -         | -         |
|  | ZQ1H EUR*     | EUR                       | (1,91) %                               | -         | -         |
| Global Emerging Markets ESG Local Debt | AC            | USD                       | 13,72 %                                | (10,77) % | (9,71) %  |
|  | BC GBP        | GBP                       | 7,98 %                                 | 1,11 %    | (8,31) %  |
|  | EC            | USD                       | 13,38 %                                | (11,03) % | (9,97) %  |
|  | ECO EUR       | EUR                       | 10,50 %                                | (13,67) % | (11,04) % |
|  | FC*           | USD                       | 11,77 %                                | -         | -         |
|  | IC            | USD                       | 14,55 %                                | (10,11) % | (9,05) %  |
|  | IC EUR        | EUR                       | 10,67 %                                | (4,22) %  | (2,14) %  |
|  | XC            | USD                       | 14,67 %                                | 9,49 %    | -         |
|  | ZC            | USD                       | 15,34 %                                | (9,48) %  | (8,42) %  |
|  | ZC EUR        | EUR                       | 11,38 %                                | (3,58) %  | (1,49) %  |
|  | ZD            | USD                       | 15,35 %                                | (9,46) %  | (8,42) %  |
| ZQ1                                    | USD           | 15,35 %                   | (10,65) %                              | -         |           |
| Global Emerging Markets Local Debt     | AC            | USD                       | 9,85 %                                 | (8,20) %  | (6,99) %  |
|  | AC EUR        | EUR                       | 6,12 %                                 | (2,18) %  | 0,07 %    |
|  | AC GBP        | GBP                       | 3,66 %                                 | 3,36 %    | (6,13) %  |
|  | AD            | USD                       | 9,85 %                                 | (8,19) %  | (6,99) %  |
|  | BC            | USD                       | 10,53 %                                | (7,62) %  | (6,41) %  |
|  | BC GBP        | GBP                       | 4,29 %                                 | 4,02 %    | (5,55) %  |
|  | BD GBP        | GBP                       | 4,27 %                                 | 4,00 %    | (5,56) %  |
|  | BQ1           | USD                       | 9,84 %                                 | 6,25 %    | (2,97) %  |
|  | EC            | USD                       | 9,51 %                                 | (8,47) %  | (7,28) %  |
|  | ECO EUR       | EUR                       | 6,81 %                                 | (11,06) % | (8,36) %  |
|  | IC            | USD                       | 10,64 %                                | (7,53) %  | (6,32) %  |
|  | IC EUR        | EUR                       | 6,90 %                                 | (1,48) %  | 0,80 %    |
|  | ICO EUR       | EUR                       | 7,93 %                                 | (9,64) %  | (7,37) %  |
|  | ID            | USD                       | 10,66 %                                | (7,54) %  | (6,31) %  |
|  | ID EUR        | EUR                       | 6,89 %                                 | (1,47) %  | 0,81 %    |
|  | XC            | USD                       | 10,78 %                                | (7,40) %  | (6,17) %  |
|  | XCO EUR       | EUR                       | 8,08 %                                 | (9,99) %  | (7,26) %  |
|  | XD            | USD                       | 10,81 %                                | (7,39) %  | (6,17) %  |
|  | ZBFIX8.5 JPY  | JPY                       | 18,91 %                                | 6,59 %    | 5,14 %    |
|  | ZC            | USD                       | 11,47 %                                | (6,83) %  | (5,61) %  |
| ZD                                     | USD           | 11,40 %                   | (6,83) %                               | (5,61) %  |           |
| ZM2                                    | USD           | 11,37 %                   | (6,91) %                               | (5,72) %  |           |
| ZQ1                                    | USD           | 11,47 %                   | (6,83) %                               | (5,62) %  |           |
| Global ESG Corporate Bond              | IC            | USD                       | 9,04 %                                 | (14,02) % | 0,53 %    |
|  | ZQ1           | USD                       | 9,43 %                                 | (13,68) % | 0,27 %    |
|  | ZQ1H EUR      | EUR                       | 6,96 %                                 | (15,65) % | (0,32) %  |
|  | ZQ1H GBP      | GBP                       | 8,53 %                                 | (14,44) % | 0,11 %    |

Die frühere Wertentwicklung stellt keinen Hinweis auf die derzeitige oder künftige Wertentwicklung dar. Die Performancedaten berücksichtigen nicht die Provisionen für die Ausgabe und Rücknahme von Anteilen.

\* Die Fonds wurden während des Geschäftsjahres aufgelegt, weshalb die Performance-Daten nicht den vollständigen 12-Monats-Zeitraum betreffen.

## Anhang VIII (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Veröffentlichung der Performancedaten für in der Schweiz vertriebene Teilfonds – Information für Schweizer Anleger (Fortsetzung)

| Teilfonds               | Anteilsklasse | Währung der Anteilsklasse | Performance während des Kalenderjahres |           |          |
|-------------------------|---------------|---------------------------|--|-----------|----------|
|                         |               |                           | 2023                                   | 2022      | 2021     |
| Global Government Bond  | BCH EUR       | EUR                       | 3,95 %                                 | (14,06) % | (3,58) % |
|                         | ICH EUR       | EUR                       | 2,70 %                                 | (14,01) % | (3,53) % |
|                         | ZC            | USD                       | 5,43 %                                 | (11,80) % | (2,33) % |
|                         | ZD            | USD                       | 5,43 %                                 | (11,78) % | (2,23) % |
|                         | ZQ1           | USD                       | 5,43 %                                 | (11,78) % | (2,23) % |
|                         | ZQ1H AUD      | AUD                       | 3,78 %                                 | (12,53) % | (2,54) % |
|                         | ZQ1H CHF      | CHF                       | 1,04 %                                 | (14,15) % | (3,43) % |
|                         | ZQ1H EUR      | EUR                       | 3,10 %                                 | (13,68) % | (3,15) % |
|                         | ZQ1H GBP      | GBP                       | 4,61 %                                 | (12,45) % | (2,44) % |
|                         | ZQ1H SGD      | SGD                       | 3,76 %                                 | (12,04) % | (2,34) % |
| Global Green Bond       | AC            | USD                       | 9,25 %                                 | (15,15) % | -        |
|                         | IC            | USD                       | 9,71 %                                 | (14,80) % | -        |
|                         | XC            | USD                       | 9,83 %                                 | (14,71) % | -        |
|                         | ZC            | USD                       | 10,12 %                                | (14,45) % | -        |
|                         | ZQ1           | USD                       | 10,12 %                                | (14,45) % | -        |
|                         | ZQ1H EUR*     | EUR                       | 4,32 %                                 | -         | -        |
|                         | ZQ1H GBP*     | GBP                       | 5,34 %                                 | -         | -        |
| Global High Income Bond | AC            | USD                       | 8,28 %                                 | (15,76) % | (1,15) % |
|                         | ACH CAD       | CAD                       | 7,59 %                                 | (15,99) % | (1,30) % |
|                         | ACH EUR       | EUR                       | 5,89 %                                 | (17,77) % | (2,10) % |
|                         | ACH GBP       | GBP                       | 7,45 %                                 | (16,54) % | (1,43) % |
|                         | ACH SGD       | SGD                       | 6,55 %                                 | (16,09) % | (1,28) % |
|                         | AD            | USD                       | 8,28 %                                 | (15,76) % | (1,15) % |
|                         | ADH EUR       | EUR                       | 5,88 %                                 | (17,78) % | (2,10) % |
|                         | AM2           | USD                       | 8,28 %                                 | (15,76) % | (1,15) % |
|                         | AM3H AUD      | AUD                       | 6,57 %                                 | (16,67) % | (1,52) % |
|                         | AM3H EUR      | EUR                       | 5,90 %                                 | (17,74) % | (2,10) % |
|                         | AM3H RMB      | RMB                       | 5,33 %                                 | (15,45) % | 1,37 %   |
|                         | AM3H SGD      | SGD                       | 6,55 %                                 | (16,08) % | (1,28) % |
|                         | BC            | USD                       | 8,91 %                                 | (15,23) % | (0,52) % |
|                         | EC            | USD                       | 7,96 %                                 | (16,01) % | (1,44) % |
|                         | ECH EUR       | EUR                       | 5,59 %                                 | (18,03) % | (2,39) % |
|                         | IC            | USD                       | 9,02 %                                 | (15,19) % | (0,47) % |
|                         | ICH EUR       | EUR                       | 6,61 %                                 | (17,21) % | (1,45) % |
|                         | ID            | USD                       | 9,00 %                                 | (15,18) % | (0,50) % |
|                         | IM2           | USD                       | 9,00 %                                 | (15,19) % | (0,49) % |
|                         | XDH EUR       | EUR                       | 6,98 %                                 | (16,90) % | (1,15) % |

Die frühere Wertentwicklung stellt keinen Hinweis auf die derzeitige oder künftige Wertentwicklung dar. Die Performancedaten berücksichtigen nicht die Provisionen für die Ausgabe und Rücknahme von Anteilen.

\* Die Fonds wurden während des Geschäftsjahres aufgelegt, weshalb die Performance-Daten nicht den vollständigen 12-Monats-Zeitraum betreffen.

## Anhang VIII (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Veröffentlichung der Performancedaten für in der Schweiz vertriebene Teilfonds – Information für Schweizer Anleger (Fortsetzung)

| Teilfonds                                 | Anteilsklasse | Währung der Anteilsklasse | Performance während des Kalenderjahres |           |          |
|---|---------------|---------------------------|--|-----------|----------|
|   |               |                           | 2023                                   | 2022      | 2021     |
| Global High Yield Bond                    | AC            | USD                       | 10,28 %                                | (13,57) % | 1,21 %   |
|   | ACH CAD       | CAD                       | 9,57 %                                 | (13,90) % | 1,04 %   |
|   | ACH GBP       | GBP                       | 9,46 %                                 | (14,44) % | 0,91 %   |
|   | AD            | USD                       | 10,28 %                                | (13,57) % | 1,21 %   |
|   | AM2           | USD                       | 10,27 %                                | (13,58) % | 1,21 %   |
|   | AM2 HKD       | HKD                       | 10,32 %                                | (13,48) % | 1,77 %   |
|   | AM3H AUD      | AUD                       | 8,51 %                                 | (14,59) % | 0,77 %   |
|   | AM3H EUR      | EUR                       | 7,81 %                                 | (15,65) % | 0,24 %   |
|   | AM3H RMB      | RMB                       | 7,30 %                                 | (13,25) % | 3,81 %   |
|   | BD GBP        | GBP                       | 4,63 %                                 | (2,16) %  | 2,69 %   |
|   | BQ1H GBP      | GBP                       | 10,07 %                                | 272,37 %  | (0,48) % |
|   | ECH EUR       | EUR                       | 7,55 %                                 | (15,93) % | (0,06) % |
|   | IC            | USD                       | 10,95 %                                | (13,06) % | 1,82 %   |
|   | ICH EUR       | EUR                       | 8,51 %                                 | (15,17) % | 0,85 %   |
|   | ID            | USD                       | 10,95 %                                | (13,06) % | 1,83 %   |
|   | ZBFIX8.5H JPY | JPY                       | 5,29 %                                 | (14,65) % | 1,87 %   |
|   | ZC            | USD                       | 11,64 %                                | (12,50) % | 2,46 %   |
|   | ZCH EUR       | EUR                       | 9,15 %                                 | (14,62) % | 1,48 %   |
|   | ZD            | USD                       | 11,59 %                                | (12,57) % | 2,41 %   |
|   | ZDH GBP       | GBP                       | 10,73 %                                | (13,41) % | 2,06 %   |
|   | ZM1H JPY      | JPY                       | 5,37 %                                 | (14,56) % | 1,98 %   |
|   | ZQ1           | USD                       | 11,63 %                                | (12,48) % | 2,47 %   |
|   | ZQ1H AUD      | AUD                       | 9,78 %                                 | (13,55) % | 2,00 %   |
|   | ZQ1H CHF      | CHF                       | 7,03 %                                 | (14,95) % | 1,26 %   |
|   | ZQ1H EUR      | EUR                       | 9,16 %                                 | (14,61) % | 1,46 %   |
| ZQ1H GBP                                  | GBP           | 10,76 %                   | (13,33) %                              | 2,14 %    |          |
| ZQ1H JPY                                  | JPY           | 5,38 %                    | (14,51) %                              | 2,02 %    |          |
| ZQ1H SGD                                  | SGD           | 9,84 %                    | (12,85) %                              | 2,33 %    |          |
| Global High Yield ESG Bond                | ACH CHF       | CHF                       | 5,55 %                                 | (14,17) % | (0,94) % |
|   | ACH EUR       | EUR                       | 7,60 %                                 | (13,87) % | (0,88) % |
|   | ACH GBP       | GBP                       | 9,19 %                                 | (12,61) % | (0,52) % |
|   | ICH CHF       | CHF                       | 6,18 %                                 | (13,69) % | (0,63) % |
|   | ICH EUR       | EUR                       | 8,22 %                                 | (13,37) % | (0,57) % |
|   | ICH GBP       | GBP                       | 9,85 %                                 | (12,09) % | (0,22) % |
|   | ZC            | USD                       | 11,32 %                                | (10,76) % | 0,28 %   |
|   | ZQ1           | USD                       | 11,25 %                                | (9,76) %  | -        |
|   | ZQ1H EUR      | EUR                       | 8,78 %                                 | (6,01) %  | -        |
| ZQ1H GBP                                  | GBP           | 10,42 %                   | (6,63) %                               | -         |          |
| Global High Yield Securitised Credit Bond | AC            | USD                       | 12,21 %                                | (4,57) %  | 5,19 %   |
|   | IC            | USD                       | 13,11 %                                | (3,82) %  | 6,03 %   |
|   | XC            | USD                       | 13,23 %                                | (3,70) %  | 6,16 %   |
|   | XCH JPY       | JPY                       | 7,12 %                                 | (5,67) %  | 5,74 %   |
|   | ZC            | USD                       | 13,99 %                                | (3,02) %  | 6,91 %   |
|   | ZCH EUR       | EUR                       | 11,54 %                                | (5,13) %  | 2,36 %   |

Die frühere Wertentwicklung stellt keinen Hinweis auf die derzeitige oder künftige Wertentwicklung dar. Die Performancedaten berücksichtigen nicht die Provisionen für die Ausgabe und Rücknahme von Anteilen.

## Anhang VIII (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Veröffentlichung der Performancedaten für in der Schweiz vertriebene Teilfonds – Information für Schweizer Anleger (Fortsetzung)

| Teilfonds                    | Anteilsklasse                                   | Währung der Anteilsklasse | Performance während des Kalenderjahres |           |          |
|------------------------------|---|---------------------------|--|-----------|----------|
|                              |   |                           | 2023                                   | 2022      | 2021     |
| Global Inflation Linked Bond | AC  | USD                       | 4,78 %                                 | (11,33) % | 2,73 %   |
|                              | ACH EUR   | EUR                       | 2,41 %                                 | (13,23) % | 1,74 %   |
|                              | AD  | USD                       | 4,77 %                                 | (11,31) % | 2,73 %   |
|                              | EC  | USD                       | 4,47 %                                 | (11,59) % | 2,42 %   |
|                              | ECH EUR   | EUR                       | 2,12 %                                 | (13,49) % | 1,44 %   |
|                              | IC  | USD                       | 5,20 %                                 | (10,97) % | 3,14 %   |
|                              | ICH EUR   | EUR                       | 2,82 %                                 | (12,87) % | 2,16 %   |
|                              | PCH EUR   | EUR                       | 3,09 %                                 | (12,65) % | 2,41 %   |
|                              | S17C  | USD                       | 5,44 %                                 | (10,77) % | 3,38 %   |
|                              | YC  | USD                       | 5,00 %                                 | (11,12) % | 2,94 %   |
|                              | YCH EUR   | EUR                       | 2,63 %                                 | (13,03) % | 1,96 %   |
|                              | ZC  | USD                       | 5,62 %                                 | (10,61) % | 3,55 %   |
|                              | ZQ1   | USD                       | 5,67 %                                 | (10,64) % | 3,59 %   |
|                              | ZQ1H CHF  | CHF                       | 1,24 %                                 | (2,90) %  | -        |
|                              | ZQ1H EUR  | EUR                       | 3,27 %                                 | (12,53) % | 2,55 %   |
|                              | ZQ1H GBP  | GBP                       | 4,80 %                                 | (11,36) % | 3,44 %   |
|                              | ZQ1H SGD  | SGD                       | 3,93 %                                 | (6,45) %  | 3,43 %   |
|                              | Global Investment Grade Securitised Credit Bond | AC                        | USD                                    | 7,67 %    | (3,19) % |
| ACH EUR                      |   | EUR                       | 5,43 %                                 | (5,27) %  | 0,26 %   |
| ACH SGD                      |   | SGD                       | 6,03 %                                 | (3,42) %  | 1,02 %   |
| ADH EUR                      |   | EUR                       | 5,42 %                                 | (5,24) %  | 0,19 %   |
| AM2                          |   | USD                       | 7,66 %                                 | (3,19) %  | 1,21 %   |
| AM2 HKD                      |   | HKD                       | 7,92 %                                 | (3,35) %  | 1,72 %   |
| AM3H AUD                     |   | AUD                       | 6,20 %                                 | (3,81) %  | 0,88 %   |
| AM3H GBP                     |   | GBP                       | 7,02 %                                 | (0,77) %  | -        |
| AM3H RMB                     |   | RMB                       | 4,84 %                                 | (2,60) %  | 3,87 %   |
| AM3H SGD                     |   | SGD                       | 6,54 %                                 | (3,40) %  | 1,10 %   |
| BCH EUR                      |   | EUR                       | 5,91 %                                 | (4,81) %  | 0,73 %   |
| BDH EUR                      |   | EUR                       | 5,88 %                                 | (4,81) %  | 0,72 %   |
| BQ1H GBP                     |   | GBP                       | 7,49 %                                 | (3,29) %  | (0,14) % |
| IC                           |   | USD                       | 8,21 %                                 | (2,71) %  | 1,70 %   |
| XC                           |   | USD                       | 8,29 %                                 | (2,63) %  | 1,87 %   |
| XCH EUR                      |   | EUR                       | 6,04 %                                 | (4,68) %  | (0,17) % |
| XCH GBP                      |   | GBP                       | 7,63 %                                 | (3,14) %  | 1,56 %   |
| ZBFIX8.5H JPY                |   | JPY                       | 2,82 %                                 | (4,36) %  | 1,69 %   |
| ZC                           |   | USD                       | 8,80 %                                 | (2,17) %  | 2,28 %   |
| ZCH GBP*                     |   | GBP                       | 1,59 %                                 | -         | -        |
| ZM1H JPY                     |   | JPY                       | 2,90 %                                 | (4,24) %  | 1,84 %   |
| ZQ1                          |   | USD                       | 8,79 %                                 | (2,17) %  | 2,26 %   |
| ZQ1H AUD                     |   | AUD                       | 7,24 %                                 | (2,81) %  | 1,89 %   |
| ZQ1H CHF                     |   | CHF                       | 4,49 %                                 | (4,59) %  | 1,06 %   |
| ZQ1H GBP                     |   | GBP                       | 8,11 %                                 | (2,71) %  | 2,00 %   |
| ZQ1H SGD                     |   | SGD                       | 7,18 %                                 | (2,38) %  | 2,14 %   |
| ZQ2H EUR                     |   | EUR                       | 6,50 %                                 | (4,24) %  | 1,31 %   |

Die frühere Wertentwicklung stellt keinen Hinweis auf die derzeitige oder künftige Wertentwicklung dar. Die Performancedaten berücksichtigen nicht die Provisionen für die Ausgabe und Rücknahme von Anteilen.

\* Die Fonds wurden während des Geschäftsjahres aufgelegt, weshalb die Performance-Daten nicht den vollständigen 12-Monats-Zeitraum betreffen.



## Anhang VIII (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Veröffentlichung der Performancedaten für in der Schweiz vertriebene Teilfonds – Information für Schweizer Anleger (Fortsetzung)

| Teilfonds                      | Anteilsklasse | Währung der Anteilsklasse | Performance während des Kalenderjahres |           |          |
|--------------------------------|---------------|---------------------------|--|-----------|----------|
|                                |               |                           | 2023                                   | 2022      | 2021     |
| Global Lower Carbon Bond       | AC            | USD                       | 9,00 %                                 | (14,91) % | (1,00) % |
|                                | ACH EUR       | EUR                       | 6,58 %                                 | (16,84) % | (1,94) % |
|                                | ACH GBP       | GBP                       | 8,13 %                                 | (15,66) % | (1,24) % |
|                                | AD            | USD                       | 8,99 %                                 | (14,91) % | (1,01) % |
|                                | ADH EUR       | EUR                       | 6,57 %                                 | (16,84) % | (1,95) % |
|                                | AM2           | USD                       | 9,00 %                                 | (14,91) % | (1,00) % |
|                                | AM2 HKD       | HKD                       | 9,04 %                                 | (14,81) % | (0,46) % |
|                                | AM3H AUD      | AUD                       | 7,24 %                                 | (15,76) % | (1,29) % |
|                                | AM3H SGD      | SGD                       | 7,22 %                                 | (15,22) % | (1,10) % |
|                                | BC            | USD                       | 9,43 %                                 | (14,57) % | (0,34) % |
|                                | BCH GBP       | GBP                       | 8,57 %                                 | (15,33) % | (0,84) % |
|                                | IC            | USD                       | 9,51 %                                 | (14,54) % | (0,56) % |
|                                | XC            | USD                       | 9,60 %                                 | (14,44) % | (0,45) % |
|                                | ZQ1           | USD                       | 9,95 %                                 | (14,14) % | (0,10) % |
|                                | ZQ1H CHF      | CHF                       | 5,37 %                                 | (16,49) % | 0,47 %   |
|                                | ZQ1H EUR      | EUR                       | 7,48 %                                 | (16,14) % | (1,06) % |
|                                | ZQ1H GBP      | GBP                       | 9,05 %                                 | (14,93) % | (0,39) % |
| Global Securitised Credit Bond | IC            | USD                       | 9,73 %                                 | (2,99) %  | 2,64 %   |
|                                | XCH GBP       | GBP                       | 9,14 %                                 | (3,28) %  | 2,47 %   |
|                                | XCH JPY       | JPY                       | 3,88 %                                 | (4,86) %  | 2,31 %   |
|                                | XD            | USD                       | 9,84 %                                 | (2,90) %  | 2,75 %   |
|                                | XDH GBP       | GBP                       | 9,11 %                                 | (3,37) %  | 0,63 %   |
|                                | ZCH EUR       | EUR                       | 8,09 %                                 | (4,29) %  | (0,21) % |
|                                | ZQ1H GBP      | GBP                       | 9,61 %                                 | (2,65) %  | 0,55 %   |
|                                | ZQ1           | USD                       | 10,41 %                                | (2,28) %  | 3,34 %   |
| Global Short Duration Bond     | AC            | USD                       | 6,39 %                                 | (5,38) %  | 0,83 %   |
|                                | AC SGD        | SGD                       | 4,08 %                                 | (5,85) %  | 3,16 %   |
|                                | ACH SGD       | SGD                       | 4,74 %                                 | (5,62) %  | 0,74 %   |
|                                | AM2           | USD                       | 6,39 %                                 | (5,38) %  | 0,82 %   |
|                                | AM2 HKD       | HKD                       | 6,66 %                                 | (5,46) %  | 1,43 %   |
|                                | AM3H AUD      | AUD                       | 4,86 %                                 | (6,07) %  | 0,47 %   |
|                                | AM3H CAD*     | CAD                       | 3,62 %                                 | -         | -        |
|                                | AM3H EUR*     | EUR                       | 3,30 %                                 | -         | -        |
|                                | AM3H GBP*     | GBP                       | 3,70 %                                 | -         | -        |
|                                | AM3H RMB      | RMB                       | 3,54 %                                 | (4,85) %  | 3,34 %   |
|                                | IC            | USD                       | 6,68 %                                 | (5,14) %  | 1,09 %   |
|                                | ICH EUR       | EUR                       | 4,43 %                                 | (7,13) %  | 0,28 %   |
|                                | S16CH GBP     | GBP                       | 6,13 %                                 | (4,08) %  | -        |
|                                | XC            | USD                       | 6,80 %                                 | (5,01) %  | 1,22 %   |
|                                | XCH EUR       | EUR                       | 4,54 %                                 | (7,01) %  | 0,01 %   |
| ZC                             | USD           | 7,01 %                    | (4,83) %                               | 1,40 %    |          |
| ZQ1H GBP                       | GBP           | 6,24 %                    | (5,43) %                               | 1,10 %    |          |

Die frühere Wertentwicklung stellt keinen Hinweis auf die derzeitige oder künftige Wertentwicklung dar. Die Performancedaten berücksichtigen nicht die Provisionen für die Ausgabe und Rücknahme von Anteilen.

\* Die Fonds wurden während des Geschäftsjahres aufgelegt, weshalb die Performance-Daten nicht den vollständigen 12-Monats-Zeitraum betreffen.

## Anhang VIII (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Veröffentlichung der Performancedaten für in der Schweiz vertriebene Teilfonds – Information für Schweizer Anleger (Fortsetzung)

| Teilfonds          | Anteilsklasse | Währung der Anteilsklasse | Performance während des Kalenderjahres |           |          |
|--------------------|---------------|---------------------------|--|-----------|----------|
|                    |               |                           | 2023                                   | 2022      | 2021     |
| India Fixed Income | AC            | USD                       | 5,45 %                                 | (9,47) %  | 0,78 %   |
|                    | AC EUR        | EUR                       | 1,88 %                                 | (3,54) %  | 8,43 %   |
|                    | AC SGD        | SGD                       | 3,72 %                                 | (9,93) %  | 2,81 %   |
|                    | AD            | USD                       | 5,45 %                                 | (9,48) %  | 0,77 %   |
|                    | AM2           | USD                       | 5,46 %                                 | (9,49) %  | 0,78 %   |
|                    | AM2 HKD       | HKD                       | 5,50 %                                 | (88,39) % | 1,33 %   |
|                    | AM30 AUD      | AUD                       | 3,92 %                                 | (39,16) % | 0,28 %   |
|                    | AM30 EUR      | EUR                       | 3,17 %                                 | (5,61) %  | (0,27) % |
|                    | AM30 RMB      | RMB                       | 2,65 %                                 | (86,86) % | 3,32 %   |
|                    | AM30 SGD      | SGD                       | 3,84 %                                 | (32,74) % | 0,59 %   |
|                    | AM30 GBP*     | GBP                       | 1,64 %                                 | -         | -        |
|                    | AM30 CAD*     | CAD                       | 1,55 %                                 | -         | -        |
|                    | BC            | USD                       | 6,03 %                                 | (8,97) %  | 1,34 %   |
|                    | BD            | USD                       | 6,02 %                                 | (8,99) %  | 1,33 %   |
|                    | BD GBP        | GBP                       | 0,04 %                                 | 2,48 %    | 2,25 %   |
|                    | EC            | USD                       | 5,14 %                                 | (9,74) %  | 0,48 %   |
|                    | IC            | USD                       | 6,15 %                                 | (8,88) %  | 1,43 %   |
|                    | IC CHF        | CHF                       | (3,45) %                               | (7,47) %  | 4,56 %   |
|                    | IC EUR        | EUR                       | 2,55 %                                 | (2,91) %  | 9,14 %   |
|                    | ID            | USD                       | 6,13 %                                 | (8,90) %  | 1,43 %   |
|                    | ID EUR        | EUR                       | 2,51 %                                 | (2,95) %  | 9,15 %   |
|                    | ID GBP        | GBP                       | 0,15 %                                 | 2,58 %    | 2,36 %   |
|                    | IM2           | USD                       | 6,14 %                                 | (8,89) %  | 1,44 %   |
|                    | XC            | USD                       | 6,29 %                                 | (8,74) %  | 1,60 %   |
|                    | XCO EUR       | EUR                       | 4,49 %                                 | (10,47) % | 0,81 %   |
|                    | XD            | USD                       | 6,28 %                                 | (8,77) %  | 1,57 %   |
| XM2                | USD           | 6,28 %                    | (8,77) %                               | 1,60 %    |          |
| ZD                 | USD           | 6,80 %                    | (8,32) %                               | 2,05 %    |          |

Die frühere Wertentwicklung stellt keinen Hinweis auf die derzeitige oder künftige Wertentwicklung dar. Die Performancedaten berücksichtigen nicht die Provisionen für die Ausgabe und Rücknahme von Anteilen.

\* Die Fonds wurden während des Geschäftsjahres aufgelegt, weshalb die Performance-Daten nicht den vollständigen 12-Monats-Zeitraum betreffen.

## Anhang VIII (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Veröffentlichung der Performancedaten für in der Schweiz vertriebene Teilfonds – Information für Schweizer Anleger (Fortsetzung)

| Teilfonds                    | Anteilsklasse | Währung der Anteilsklasse | Performance während des Kalenderjahres |           |          |
|------------------------------|---------------|---------------------------|--|-----------|----------|
|                              |               |                           | 2023                                   | 2022      | 2021     |
| RMB Fixed Income             | AC            | USD                       | 1,11 %                                 | (10,95) % | 2,27 %   |
|                              | AC EUR        | EUR                       | (2,89) %                               | (5,06) %  | 10,04 %  |
|                              | AC RMB        | RMB                       | 3,09 %                                 | (2,62) %  | (0,33) % |
|                              | ACO EUR       | EUR                       | (1,19) %                               | (13,14) % | 1,20 %   |
|                              | ACO SGD       | SGD                       | (0,57) %                               | (11,40) % | 2,07 %   |
|                              | AD            | USD                       | 1,12 %                                 | (10,95) % | 2,28 %   |
|                              | AD EUR        | EUR                       | (2,89) %                               | (5,07) %  | 10,05 %  |
|                              | AM2           | USD                       | 1,11 %                                 | (10,94) % | 2,27 %   |
|                              | AM2 HKD       | HKD                       | 1,25 %                                 | (11,05) % | (0,07) % |
|                              | AM2 RMB       | RMB                       | 3,09 %                                 | (2,60) %  | (0,33) % |
|                              | AM30 SGD      | SGD                       | (0,60) %                               | (11,37) % | 2,06 %   |
|                              | BC            | USD                       | 1,51 %                                 | (10,61) % | 2,66 %   |
|                              | EC            | USD                       | 0,81 %                                 | (11,21) % | 1,97 %   |
|                              | ECO EUR       | EUR                       | (1,47) %                               | (13,40) % | 0,91 %   |
|                              | IC            | USD                       | 1,54 %                                 | (10,56) % | 2,70 %   |
|                              | IC EUR        | EUR                       | (2,47) %                               | (4,65) %  | 10,51 %  |
|                              | IC RMB        | RMB                       | 3,52 %                                 | (2,20) %  | 0,09 %   |
|                              | ICO EUR       | EUR                       | (0,78) %                               | (12,77) % | 1,63 %   |
|                              | ID            | USD                       | 1,56 %                                 | (10,58) % | 2,71 %   |
|                              | XD EUR        | EUR                       | (2,41) %                               | (6,63) %  | -        |
| XD10 EUR                     | EUR           | (0,69) %                  | (12,04) %                              | -         |          |
| ZC                           | USD           | 1,95 %                    | (10,18) %                              | 3,10 %    |          |
| Singapore Dollar Income Bond | AC            | SGD                       | 3,53 %                                 | (10,70) % | (3,31) % |
|                              | ACH AUD       | AUD                       | 3,39 %                                 | (11,30) % | (3,69) % |
|                              | AM2           | SGD                       | 3,54 %                                 | (10,71) % | (3,31) % |
|                              | AM3H AUD      | AUD                       | 3,35 %                                 | (11,29) % | (3,69) % |
|                              | AM3H USD      | USD                       | 4,99 %                                 | (10,59) % | (3,34) % |
|                              | IC            | SGD                       | 4,05 %                                 | (10,26) % | (2,82) % |
| Ultra Short Duration Bond    | AC            | USD                       | 6,02 %                                 | 1,08 %    | 0,01 %   |
|                              | BC            | USD                       | 6,22 %                                 | 1,23 %    | 0,06 %   |
|                              | BM2           | USD                       | 6,23 %                                 | 1,21 %    | 0,13 %   |
|                              | BM3H GBP      | GBP                       | 5,57 %                                 | 0,68 %    | (0,09) % |
|                              | IC*           | USD                       | 4,81 %                                 | -         | -        |
|                              | PC            | USD                       | 6,12 %                                 | 1,18 %    | 0,13 %   |
|                              | PC HKD        | HKD                       | 6,17 %                                 | 1,29 %    | 0,40 %   |
|                              | PCH AUD       | AUD                       | 4,70 %                                 | 0,48 %    | (0,02) % |
|                              | PCH GBP       | GBP                       | 5,47 %                                 | 0,63 %    | -        |
|                              | PCH RMB       | RMB                       | 3,33 %                                 | 1,71 %    | 1,25 %   |
|                              | PM2           | USD                       | 6,12 %                                 | 1,18 %    | 0,13 %   |
|                              | PM2 HKD       | HKD                       | 6,17 %                                 | 1,29 %    | 0,43 %   |
|                              | PM3H AUD      | AUD                       | 4,62 %                                 | 0,51 %    | (0,07) % |
|                              | PM3H EUR      | EUR                       | 3,91 %                                 | (0,29) %  | (0,30) % |
|                              | PM3H GBP      | GBP                       | 5,45 %                                 | 0,66 %    | (0,11) % |
|                              | PM3H RMB      | RMB                       | 3,34 %                                 | 1,69 %    | 0,83 %   |
|                              | PM3H SGD      | SGD                       | 4,53 %                                 | 0,98 %    | (0,07) % |
|                              | UM2           | USD                       | 6,28 %                                 | 1,42 %    | -        |
|                              | UM2 HKD       | HKD                       | 6,33 %                                 | 0,92 %    | -        |
|                              | XC*           | USD                       | 2,96 %                                 | -         | -        |
| XCH EUR                      | EUR           | 4,11 %                    | 0,69 %                                 | -         |          |
| XCH GBP                      | GBP           | 5,64 %                    | 0,79 %                                 | -         |          |
| ZM                           | USD           | 6,49 %                    | 1,41 %                                 | 0,23 %    |          |

Die frühere Wertentwicklung stellt keinen Hinweis auf die derzeitige oder künftige Wertentwicklung dar. Die Performancedaten berücksichtigen nicht die Provisionen für die Ausgabe und Rücknahme von Anteilen.

\* Die Fonds wurden während des Geschäftsjahres aufgelegt, weshalb die Performance-Daten nicht den vollständigen 12-Monats-Zeitraum betreffen.

## Anhang VIII (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Veröffentlichung der Performancedaten für in der Schweiz vertriebene Teilfonds – Information für Schweizer Anleger (Fortsetzung)

| Teilfonds                                      | Anteilsklasse | Währung der Anteilsklasse | Performance während des Kalenderjahres |           |          |
|--|---------------|---------------------------|--|-----------|----------|
|  |               |                           | 2023                                   | 2022      | 2021     |
| US Dollar Bond                                 | AC            | USD                       | 4,96 %                                 | (14,78) % | (1,75) % |
|  | AD            | USD                       | 4,95 %                                 | (14,78) % | (1,75) % |
|  | AM2           | USD                       | 4,96 %                                 | (14,78) % | (1,75) % |
|  | AM2 HKD       | HKD                       | 5,01 %                                 | (14,69) % | (1,22) % |
|  | AM3H CAD*     | CAD                       | 5,00 %                                 | -         | -        |
|  | AM3H EUR*     | EUR                       | 4,67 %                                 | -         | -        |
|  | AM3H GBP*     | GBP                       | 5,08 %                                 | -         | -        |
|  | EC            | USD                       | 4,65 %                                 | (15,03) % | (2,05) % |
|  | IC            | USD                       | 5,46 %                                 | (14,37) % | (1,29) % |
|  | ID            | USD                       | 5,45 %                                 | (14,37) % | (1,29) % |
|  | PD            | USD                       | 5,21 %                                 | (14,56) % | (1,50) % |
|  | WD            | USD                       | 6,00 %                                 | (13,92) % | (0,76) % |
|  | ZC            | USD                       | 5,86 %                                 | (14,05) % | (0,91) % |
| ZD   | USD           | 5,84 %                    | (14,05) %                              | (0,92) %  |          |
| US High Yield Bond                             | AC            | USD                       | 9,93 %                                 | (14,46) % | 4,04 %   |
|  | AM2           | USD                       | 9,91 %                                 | (14,46) % | 4,03 %   |
|  | AM2 HKD       | HKD                       | 9,96 %                                 | (14,37) % | 4,61 %   |
|  | AM3H AUD      | AUD                       | 8,09 %                                 | (15,55) % | 3,60 %   |
|  | AM3H RMB      | RMB                       | 6,93 %                                 | (14,18) % | 6,74 %   |
|  | AQ1           | USD                       | 9,91 %                                 | (14,45) % | 4,03 %   |
|  | IC            | USD                       | 10,67 %                                | (13,91) % | 4,71 %   |
|  | IQ1           | USD                       | 10,65 %                                | (13,88) % | 4,71 %   |
|  | XC            | USD                       | 10,69 %                                | (13,86) % | 4,75 %   |
|  | XQ1           | USD                       | 10,69 %                                | (13,83) % | 4,77 %   |
|  | ZC            | USD                       | 11,19 %                                | (13,47) % | 5,23 %   |
|  | ZD            | USD                       | 11,20 %                                | (13,49) % | 5,25 %   |
|  | ZQ1           | USD                       | 11,19 %                                | (13,45) % | 5,25 %   |
| US Short Duration High Yield Bond <sup>2</sup> | AC            | USD                       | 10,07 %                                | (7,67) %  | 3,78 %   |
|  | ACH EUR       | EUR                       | 7,68 %                                 | (9,82) %  | 2,79 %   |
|  | AD            | USD                       | 10,07 %                                | (7,68) %  | 3,79 %   |
|  | ADH EUR       | EUR                       | 7,66 %                                 | (9,87) %  | 2,80 %   |
|  | EC            | USD                       | 9,63 %                                 | (8,04) %  | 3,36 %   |
|  | ECH EUR       | EUR                       | 7,24 %                                 | (10,18) % | 2,38 %   |
|  | ED            | USD                       | 9,63 %                                 | (8,05) %  | 3,37 %   |
|  | IC            | USD                       | 10,62 %                                | (7,21) %  | 4,30 %   |
|  | IC EUR        | EUR                       | 6,88 %                                 | (1,14) %  | 12,21 %  |
|  | ICH EUR       | EUR                       | 8,22 %                                 | (9,37) %  | 3,31 %   |
|  | ZC            | USD                       | 11,12 %                                | (6,78) %  | 4,78 %   |
|  | ZQ1           | USD                       | 11,13 %                                | (6,75) %  | 4,82 %   |
|  | ZQ1H CHF      | CHF                       | 6,63 %                                 | (9,30) %  | 3,60 %   |
|  | ZQ1H EUR      | EUR                       | 8,69 %                                 | (8,93) %  | 3,77 %   |
|  | ZQ1H GBP      | GBP                       | 10,32 %                                | (7,60) %  | 4,47 %   |
| ZQ1H SGD                                       | SGD           | 9,37 %                    | (7,14) %                               | 4,66 %    |          |
| Global Emerging Markets Multi-Asset Income     | AC            | USD                       | 9,51 %                                 | (13,37) % | (5,51) % |
|  | AM2           | USD                       | 9,51 %                                 | (13,37) % | (5,51) % |
|  | AM2 HKD       | HKD                       | 9,78 %                                 | (13,44) % | (4,92) % |
|  | AM30 AUD      | AUD                       | 7,49 %                                 | (14,63) % | (6,14) % |
|  | AM30 EUR      | EUR                       | 6,90 %                                 | (15,72) % | (6,54) % |
|  | AM30 GBP      | GBP                       | 8,53 %                                 | (14,42) % | (5,92) % |
|  | AM30 RMB      | RMB                       | 6,43 %                                 | (13,16) % | (3,18) % |
|  | AM30 SGD      | SGD                       | 7,64 %                                 | (13,83) % | (5,76) % |

Die frühere Wertentwicklung stellt keinen Hinweis auf die derzeitige oder künftige Wertentwicklung dar. Die Performancedaten berücksichtigen nicht die Provisionen für die Ausgabe und Rücknahme von Anteilen.

<sup>2</sup> Bis zum 2. Juli 2023 lautete der Name des Teilfonds „Global Short Duration High Yield Bond“.

\* Die Fonds wurden während des Geschäftsjahres aufgelegt, weshalb die Performance-Daten nicht den vollständigen 12-Monats-Zeitraum betreffen.

## Anhang VIII (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Veröffentlichung der Performancedaten für in der Schweiz vertriebene Teilfonds – Information für Schweizer Anleger (Fortsetzung)

| Teilfonds                                     | Anteilsklasse             | Währung der Anteilsklasse | Performance während des Kalenderjahres |           |          |
|---|---------------------------|---------------------------|--|-----------|----------|
|   |                           |                           | 2023                                   | 2022      | 2021     |
| Managed Solutions – Asia Focused Conservative | AC                        | USD                       | 3,37 %                                 | (13,18) % | (3,38) % |
|   | AC HKD                    | HKD                       | 3,42 %                                 | (13,09) % | (2,86) % |
|   | ACO AUD                   | AUD                       | 1,64 %                                 | (14,15) % | (3,91) % |
|   | ACO EUR                   | EUR                       | 1,08 %                                 | (15,25) % | (4,38) % |
|   | ACO SGD                   | SGD                       | 1,69 %                                 | (13,55) % | (3,56) % |
|   | AM2                       | USD                       | 3,36 %                                 | (13,19) % | (3,38) % |
|   | AM2 HKD                   | HKD                       | 3,41 %                                 | (13,10) % | (2,85) % |
|   | AM30 RMB                  | RMB                       | 0,47 %                                 | (12,90) % | (0,96) % |
| Managed Solutions – Asia Focused Growth       | AC                        | USD                       | 0,89 %                                 | (24,83) % | (5,29) % |
|   | AC HKD                    | HKD                       | 0,94 %                                 | (24,74) % | (4,78) % |
|   | ACO AUD                   | AUD                       | (1,04) %                               | (26,43) % | (6,15) % |
|   | ACO EUR                   | EUR                       | (1,46) %                               | (27,09) % | (6,37) % |
|   | ACO SGD                   | SGD                       | (0,86) %                               | (25,48) % | (5,62) % |
|   | AM2                       | USD                       | 0,88 %                                 | (24,82) % | (5,29) % |
| Managed Solutions – Asia Focused Income       | AC                        | USD                       | 4,65 %                                 | (16,56) % | (4,71) % |
|   | ACO SGD                   | SGD                       | 2,91 %                                 | (16,97) % | (4,91) % |
|   | AM2                       | USD                       | 4,65 %                                 | (16,57) % | (4,70) % |
|   | AM2 HKD                   | HKD                       | 4,69 %                                 | (16,48) % | (4,17) % |
|   | AM30 AUD                  | AUD                       | 2,77 %                                 | (17,55) % | (5,27) % |
|   | AM30 CAD*                 | CAD                       | 4,47 %                                 | -         | -        |
|   | AM30 EUR                  | EUR                       | 2,27 %                                 | (18,62) % | (5,68) % |
|   | AM30 GBP*                 | GBP                       | 4,57 %                                 | -         | -        |
|   | AM30 RMB                  | RMB                       | 1,64 %                                 | (16,35) % | (2,32) % |
|   | AM30 SGD                  | SGD                       | 2,91 %                                 | (16,97) % | (4,89) % |
|   | EC                        | USD                       | 4,33 %                                 | (16,81) % | (4,99) % |
|   | ECH EUR                   | EUR                       | 1,98 %                                 | (18,86) % | (5,96) % |
|   | XC                        | USD                       | 5,49 %                                 | (15,90) % | (4,46) % |
|   | Multi-Asset Style Factors | AC                        | EUR                                    | 1,86 %    | 0,09 %   |
| AD  |                           | EUR                       | 1,86 %                                 | 0,09 %    | (3,62) % |
| BC  |                           | EUR                       | 2,58 %                                 | 0,79 %    | (2,95) % |
| BCH GBP                                       |                           | GBP                       | 4,01 %                                 | 2,31 %    | (2,38) % |
| EC  |                           | EUR                       | 1,35 %                                 | (0,40) %  | (4,10) % |
| IC  |                           | EUR                       | 2,57 %                                 | 0,79 %    | (2,95) % |
| ID  |                           | EUR                       | 2,58 %                                 | 0,79 %    | (2,95) % |
| XC  |                           | EUR                       | 2,81 %                                 | 1,04 %    | (2,85) % |
| XCH JPY                                       |                           | JPY                       | (0,69) %                               | 1,13 %    | (2,21) % |
| ZC  |                           | EUR                       | 3,39 %                                 | 1,59 %    | (2,15) % |
| ZCH CHF                                       |                           | CHF                       | 1,21 %                                 | 1,20 %    | (2,47) % |
| ZCH GBP                                       |                           | GBP                       | 4,82 %                                 | 3,14 %    | (1,66) % |
| ZCH USD                                       |                           | USD                       | 5,55 %                                 | 3,68 %    | (1,36) % |

Die frühere Wertentwicklung stellt keinen Hinweis auf die derzeitige oder künftige Wertentwicklung dar. Die Performancedaten berücksichtigen nicht die Provisionen für die Ausgabe und Rücknahme von Anteilen.

\* Die Fonds wurden während des Geschäftsjahres aufgelegt, weshalb die Performance-Daten nicht den vollständigen 12-Monats-Zeitraum betreffen.

## Anhang VIII (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Veröffentlichung der Performancedaten für in der Schweiz vertriebene Teilfonds – Information für Schweizer Anleger (Fortsetzung)

| Teilfonds                    | Anteilsklasse | Währung der Anteilsklasse | Performance während des Kalenderjahres |           |          |
|------------------------------|---------------|---------------------------|--|-----------|----------|
|                              |               |                           | 2023                                   | 2022      | 2021     |
| Multi-Strategy Target Return | AC            | EUR                       | 1,15 %                                 | (4,70) %  | (1,06) % |
|                              | IC            | EUR                       | 1,91 %                                 | (3,78) %  | (0,02) % |
|                              | ICH GBP       | GBP                       | 3,33 %                                 | (2,50) %  | 0,51 %   |
|                              | ID            | EUR                       | 1,89 %                                 | (3,78) %  | (0,05) % |
|                              | XC            | EUR                       | 2,05 %                                 | (3,79) %  | (0,12) % |
|                              | XCH GBP       | GBP                       | 3,51 %                                 | (2,50) %  | 0,39 %   |
|                              | ZCH GBP       | GBP                       | 4,16 %                                 | (1,87) %  | 0,04 %   |
| US Income Focused            | AM2           | USD                       | 13,63 %                                | (14,89) % | 11,32 %  |
|                              | AM2 HKD       | HKD                       | 13,90 %                                | (14,95) % | 11,98 %  |
|                              | AM3H AUD      | AUD                       | 11,51 %                                | (16,33) % | 11,08 %  |
|                              | AM3H CAD      | CAD                       | 12,72 %                                | (15,50) % | 11,07 %  |
|                              | AM3H EUR      | EUR                       | 10,73 %                                | (17,19) % | 11,49 %  |
|                              | AM3H GBP      | GBP                       | 12,57 %                                | (16,06) % | 11,37 %  |
|                              | AM3H RMB      | RMB                       | 10,48 %                                | (14,63) % | 12,47 %  |

Die frühere Wertentwicklung stellt keinen Hinweis auf die derzeitige oder künftige Wertentwicklung dar. Die Performancedaten berücksichtigen nicht die Provisionen für die Ausgabe und Rücknahme von Anteilen.

# Anhang IX (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor („SFDR“)

## ESG-Berichterstattung

Am 10. März 2021 trat die Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor („Offenlegungsverordnung“) in Kraft. Die Offenlegungsverordnung sieht einen harmonisierten Ansatz für die Offenlegung von nachhaltigkeitsbezogenen Informationen gegenüber Anlegern in der Europäischen Union vor.

## Anlagen gemäß Artikel 6

Die Anlagen, die diesen Finanzprodukten zugrunde liegen, berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für eine ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeit.

### ▶ Rententeilfonds gemäß Artikel 6 der Offenlegungsverordnung

- ▶ Asia Bond
- ▶ Asia High Yield Bond
- ▶ Asian Currencies Bond
- ▶ Brazil Bond
- ▶ Euro Bond Total Return
- ▶ GEM Debt Total Return
- ▶ Global Emerging Markets Bond
- ▶ Global Emerging Markets Local Debt
- ▶ Global High Yield Bond
- ▶ US Short Duration High Yield Bond\*\*
- ▶ India Fixed Income
- ▶ RMB Fixed Income
- ▶ Singapore Dollar Income Bond
- ▶ US High Yield Bond

### ▶ International and Regional Equity SFDR Article 6

- ▶ BRIC Equity
- ▶ BRIC Markets Equity
- ▶ Frontier Markets
- ▶ Global Equity Volatility Focused

### ▶ Market Specific Equity SFDR Article 6

- ▶ Brazil Equity
- ▶ Economic Scale US Equity
- ▶ Indian Equity
- ▶ Mexico Equity (geschlossen zum 28. Juli 2023)
- ▶ Russia Equity\*
- ▶ Turkey Equity

\* Die Anlage in dem Teilfonds Russia Equity ist derzeit ausgesetzt.

\*\* Bis zum 2. Juli 2023 lautete der Name des Teilfonds „Global Short Duration High Yield Bond“.

# Anhang IX (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor („SFDR“) (Fortsetzung)

## ESG-Berichterstattung (Fortsetzung)

### Anlagen gemäß Artikel 6 (Fortsetzung)

#### ▶ Andere gemäß Artikel 6 der Offenlegungsverordnung

- ▶ Global Credit Floating Rate Fixed Term Bond 2023 – 1 (geschlossen zum 5. Juli 2023)
- ▶ Global Credit Floating Rate Fixed Term Bond 2023 – 2 (geschlossen zum 29. Dezember 2023)
- ▶ Global Emerging Markets Multi-Asset Income
- ▶ Managed Solutions – Asia Focused Conservative
- ▶ Managed Solutions – Asia Focused Growth
- ▶ Managed Solutions – Asia Focused Income
- ▶ Multi-Asset Style Factors
- ▶ Multi-Strategy Target Return
- ▶ US Income Focused

### Anlagen gemäß Artikel 8

Um die Voraussetzungen als Teilfonds gemäß Artikel 8 der Offenlegungsverordnung zu erfüllen, musste der betreffende Teilfonds ein oder mehrere soziale oder ökologische Merkmale bewerben. HSBC Asset Management vertritt die Position, dass die große Mehrheit der Vermögenswerte starke und sich verbessernde Merkmale aufweisen sollte. Darüber hinaus haben alle Teilfonds gemäß Artikel 8 der Offenlegungsverordnung als Nachhaltigkeitsindikator alle obligatorischen wichtigsten nachteiligen Auswirkungen aktiv in ihren Anlageentscheidungsprozess einbezogen und berücksichtigen aktiv alle relevanten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen.

#### ▶ Rententeilfonds gemäß Artikel 8 der Offenlegungsverordnung

- |  |   |
|--|---|
| ▶ Asia ESG Bond                          | ▶ Global High Income Bond   |
| ▶ Euro Bond                              | ▶ Global High Yield ESG Bond  |
| ▶ Euro Credit Bond                       | ▶ Global High Yield Securitised Credit Bond                         |
| ▶ Euro High Yield Bond                   | ▶ Global Inflation Linked Bond                                      |
| ▶ ESG Short Duration Credit Bond         | ▶ Global Investment Grade Securitised Credit Bond                   |
| ▶ Global Bond                            | ▶ Global Lower Carbon Bond  |
| ▶ Global Bond Total Return               | ▶ Global Securitised Credit Bond                                    |
| ▶ Global Corporate Bond                  | ▶ Global Short Duration Bond  |
| ▶ Global Emerging Markets ESG Bond       | ▶ Ultra Short Duration Bond   |
| ▶ Global Emerging Markets ESG Local Debt | ▶ US Dollar Bond  |
| ▶ Global ESG Corporate Bond              | ▶ Corporate Euro Bond Fixed Term 2027 (aufgelegt zum 30. Juni 2023) |
| ▶ Global Government Bond                 |   |
| ▶ Global Green Bond                      |   |



# Anhang IX (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor („SFDR“) (Fortsetzung)

## ESG-Berichterstattung (Fortsetzung)

### Anlagen gemäß Artikel 8 (Fortsetzung)

#### ▶ **Aktienteilfonds gemäß Artikel 8 der Offenlegungsverordnung**

- ▶ ASEAN Equity \*
- ▶ Asia ex Japan Equity
- ▶ Asia ex Japan Equity Smaller Companies
- ▶ Asia Pacific ex Japan Equity High Dividend
- ▶ China A-Shares Equity
- ▶ Chinese Equity
- ▶ Euroland Equity Smaller Companies
- ▶ Euroland Growth
- ▶ Euroland Value
- ▶ Europe Value
- ▶ Global Emerging Markets Equity
- ▶ Global Equity Climate Change
- ▶ Global Infrastructure Equity
- ▶ Global Lower Carbon Equity
- ▶ Global Real Estate Equity
- ▶ Global Sustainable Equity Income
- ▶ Global Sustainable Long Term Dividend
- ▶ Global Equity Sustainable Healthcare
- ▶ Hong Kong Equity

\* Bis zum 31. Juli 2023 lautete der Name des Teilfonds „Thai Equity“.

### Anlagen gemäß Artikel 9

Um die Voraussetzungen als Teilfonds gemäß Artikel 9 der Offenlegungsverordnung zu erfüllen, hatte jeder Teilfonds speziell nachhaltige Ziele oder eine Reduzierung der Kohlenstoffemissionen zum Ziel. HSBC Asset Management vertritt die Position, dass die große Mehrheit der Vermögenswerte starke und sich verbessernde Merkmale aufweisen sollte. Darüber hinaus ist ein Teilfonds gemäß Artikel 9 verpflichtet, das Portfolio des Teilfonds unter Berücksichtigung der PAI und unter Berücksichtigung des in der Taxonomieverordnung (EU) 2020/852 über die Einrichtung eines Rahmens zur Erleichterung nachhaltiger Investitionen festgelegten sozialen Mindestschutzes zu bewerten.

#### ▶ **Rententeilfonds gemäß Artikel 9 der Offenlegungsverordnung**

- ▶ Global Emerging Markets Corporate Sustainable Bond

#### ▶ **Aktienteilfonds gemäß Artikel 9 der Offenlegungsverordnung**

- ▶ Global Equity Circular Economy
- ▶ Global Sustainable Long Term Equity

# Anhang IX (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor („SFDR“) (Fortsetzung)

## Berücksichtigung der ESG-Referenzen des Unternehmens

Die Teilfonds beinhalteten die Identifizierung und Analyse der ESG-Referenzen („ESG-Referenzen“) eines Unternehmens als wesentlichen Bestandteil des Anlageentscheidungsprozesses zur Reduzierung des Risikos und zur Steigerung der Renditen.

Zu den ESG-Referenzen zählten unter anderem:

- ▶ Ökologische und soziale Faktoren, insbesondere die physischen Risiken des Klimawandels und des Personalmanagements, die erhebliche Auswirkungen auf die finanzielle Performance und die Bewertung eines Wertpapieremittenten haben konnten
- ▶ Corporate-Governance-Praktiken, die die Interessen von Minderheitsinvestoren schützten und eine langfristige nachhaltige Wertschöpfung förderten.

Die ESG-Referenzen sind HSBC-spezifisch, unterliegen kontinuierlichem Research und können sich im Laufe der Zeit ändern, wenn neue Kriterien identifiziert werden. Der Einschluss eines Unternehmens in das Anlageuniversum des Teilfonds lag im Ermessen des Anlageberaters. Emittenten mit sich verbessernden ESG-Referenzen wurden möglicherweise aufgenommen, während ihre Referenzen noch begrenzt waren.

## Ausgeschlossene Aktivitäten

Die ESG-Referenzen sind HSBC-spezifisch, unterliegen kontinuierlichem Research und können sich im Laufe der Zeit ändern, wenn neue Kriterien identifiziert werden. Ungeachtet der nachstehend beschriebenen ausgeschlossenen Aktivitäten erfolgt die Aufnahme eines Emittenten in das Anlageuniversum eines Teilfonds gemäß Artikel 8 der Offenlegungsverordnung im Ermessen des Anlageberaters. Emittenten mit sich verbessernden ESG-Referenzen können aufgenommen werden, wenn ihre Referenzen noch begrenzt sind. Ebenso könnte HSBC Emittenten, deren ESG-Referenzen sich verschlechtern, auf die Ausschlusslisten setzen und die Vermögenswerte veräußern.

Teilfonds gemäß Artikel 8 der Offenlegungsverordnung investieren nicht in Wertpapiere von Emittenten, die eine besondere Beteiligung an bestimmten ausgeschlossenen Aktivitäten aufweisen („ausgeschlossene Aktivitäten“). Ausgeschlossene Aktivitäten und die besondere Beteiligung sind HSBC-spezifisch und können unter anderem Folgendes umfassen:

- ▶ Unternehmen, die an der Herstellung umstrittener Waffen oder deren Hauptkomponenten beteiligt sind. Umstrittene Waffen sind unter anderem Antipersonenminen, Waffen mit abgereichertem Uran und weißer Phosphor, wenn dieser für militärische Zwecke verwendet wird. Dieser Ausschluss gilt zusätzlich zur Richtlinie von HSBC Asset Management zu verbotenen Waffen.
- ▶ Unternehmen, die an der Herstellung von Tabak beteiligt sind.
- ▶ Unternehmen mit einem Umsatz von mehr als 10 % aus der Förderung von Kraftwerkskohle, die nicht über einen klar definierten, glaubwürdigen Plan verfügen, das Engagement auf unter 10 % zu reduzieren.
- ▶ Unternehmen mit einem Umsatz von mehr als 10 % aus kohlebasierter Energieerzeugung, die nicht über einen klar definierten und glaubwürdigen Plan verfügen, das Engagement auf unter 10 % zu reduzieren.

HSBC Asset Management führt grundsätzlich verstärkte Due-Diligence-Prüfungen bei Unternehmen durch, die als nicht konform mit den Prinzipien des UN Global Compact angesehen wurden oder die nach den unternehmenseigenen ESG-Ratings von HSBC als risikoreich angesehen wurden. Daher investiert keiner der oben genannten Teilfonds wissentlich in Unternehmen, die gemäß der von HSBC vorgenommenen Bewertung schwerwiegende Verstöße gegen die Prinzipien des UN Global Compact begangen haben. Wenn nach dem Kauf schwerwiegende Verstöße festgestellt wurden, hat sich der Teilfonds von diesen Emittenten getrennt.

ESG-Referenzen, ausgeschlossene Aktivitäten und die Notwendigkeit verstärkter Due-Diligence-Prüfungen wurden identifiziert und analysiert, indem unter anderem das proprietäre ESG-Wesentlichkeits-Framework und eigene Ratings von HSBC, eine qualitative Fundamentalanalyse und das Unternehmensengagement berücksichtigt wurde. Die Anlageberater stützen sich außerdem auf Fachwissen, Analysen und Informationen von Finanzdaten- und sonstigen Datenanbietern.

Bestimmte einzelne Teilfonds nahmen zusätzliche Ausschlüsse vor, die im Verkaufsprospekt detailliert aufgeführt sind. Dieser steht unter [www.assetmanagement.hsbc.com](http://www.assetmanagement.hsbc.com) zur Verfügung.

# Anhang IX (Ungeprüfte zusätzliche Angaben) – Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor („SFDR“) (Fortsetzung)

## Taxonomie

Die Taxonomieverordnung wurde eingeführt, um ein EU-weites Klassifizierungssystem bereitzustellen, das Anlegern und Beteiligungsunternehmen einen gemeinsamen Rahmen bietet, um festzustellen, ob bestimmte Wirtschaftstätigkeiten als ökologisch nachhaltig angesehen werden könnten.

Die Taxonomieverordnung führt zusätzliche Offenlegungspflichten für Teilfonds gemäß Artikel 8 und Artikel 9 der Offenlegungsverordnung ein. Bei Teilfonds gemäß Artikel 6 der Offenlegungsverordnung berücksichtigen die diesen Teilfonds zugrunde liegenden Anlagen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten. Wie bereits im Abschnitt „Integration von Nachhaltigkeitsrisiken in Anlageentscheidungen“ dargelegt, berücksichtigen die Anlageberater bei der Verwaltung dieser Teilfonds jedoch Nachhaltigkeitsrisiken.

Gemäß der Taxonomieverordnung galt eine Wirtschaftstätigkeit als ökologisch nachhaltig, wenn diese Wirtschaftstätigkeit:

- ▶ einen wesentlichen Beitrag zur Verwirklichung eines oder mehrerer definierter Umweltziele leistete;
- ▶ nicht zu einer erheblichen Beeinträchtigung eines oder mehrerer der Umweltziele führte;
- ▶ unter Einhaltung eines festgelegten sozialen Mindestschutzes ausgeübt wurde; und
- ▶ bestimmte Leistungsschwellen, die sogenannten technischen Bewertungskriterien, einhielt.

In Bezug auf die Punkte 1 und 2 werden in der Taxonomieverordnung sechs Umweltziele definiert:

- ▶ Klimaschutz;
- ▶ Anpassung an den Klimawandel;
- ▶ nachhaltige Nutzung und Schutz von Wasser- und Meeresressourcen;
- ▶ Übergang zu einer Kreislaufwirtschaft;
- ▶ Vermeidung und Verminderung der Umweltverschmutzung; und
- ▶ Schutz und Wiederherstellung der Biodiversität und der Ökosysteme.

Alle Informationen zur Ausrichtung des Teilfonds auf diese Umweltziele sind im Anhang des letzten Prospekts mit Stand vom Januar 2024 aufgeführt.

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen 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.

Name des Produkts: HSBC GLOBAL INVESTMENT FUNDS - ASIA ESG BOND

Unternehmenskennung (LEI-Code): 213800LS9Z4S1Z1SZ562

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

| <input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> <b>Ja</b>  | <input type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> <b>Nein</b>  |
|---|---|
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel</b> getätigt: _ %<br><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel</b> getätigt: _ % | <input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit <b>ökologische/soziale Merkmale beworben</b> und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 35,23 % an nachhaltigen Investitionen<br><input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel<br><input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine <b>nachhaltigen Investitionen getätigt</b> |



### Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Während des am 31. März 2024 endenden Geschäftsjahres (der Bezugszeitraum) hat der Teilfonds Folgendes beworben:

1. Es wurde auf das Erreichen eines ESG-Score des Teilfonds hingearbeitet, der über dem vom Teilfonds ausgewählten Referenzindex liegt (ein höherer Score als der Referenzwert bedeutet bessere ESG-Referenzen).
2. Der Teilfonds berücksichtigte verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Grundsätzen des Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC) und den Leitsätzen für multinationale Unternehmen der Organisation für wirtschaftliche

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für Unternehmen. Wurden potenzielle Verstöße gegen die Prinzipien des UNGC festgestellt, wurden die Emittenten einer eigenen Due-Diligence-Prüfung hinsichtlich ESG-Themen unterzogen, um festzustellen, ob sie für die Aufnahme in das Portfolio des Teilfonds geeignet sind, und sie auszuschließen, falls sie als ungeeignet erachtet wurden.

3. Der Teilfonds schloss Geschäftstätigkeiten aus, die als umweltschädlich gelten, wie z. B. die Förderung von Kraftwerkskohle und die Kohleverstromung.

4. Der Teilfonds prüfte und analysierte alle Unternehmen oder Emittenten im Hinblick auf ökologische Merkmale, insbesondere physische Risiken durch den Klimawandel und Personalmanagement. Für die zugrunde liegenden E-, S- und G-Säulen wurden ein Screening sowie ein Vergleich mit dem für den Teilfonds definierten Referenzwert durchgeführt. „E“ und „S“ spiegeln die einzelnen Elemente der vom Teilfonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale wider, „G“ die Unternehmensführungspraktiken, die die Interessen von Minderheitsaktionären schützen und eine langfristige nachhaltige Wertschöpfung fördern.

5. Der Teilfonds berücksichtigte aktiv ökologische und soziale Aspekte, indem er über unsere Engagement- und Stewardship-Teams Mitwirkung bei Emittenten umsetzte und sein Recht zur Stimmrechtsvertretung wahrnahm.

6. Der Teilfonds schloss nach entsprechender Analyse Anlagen in umstrittenen Waffen aus.

Die auf ESG und Nachhaltigkeitsindikatoren bezogenen Scores werden anhand der proprietären Methodik von HSBC Asset Management und externer ESG-Datenanbieter berechnet. Die Berücksichtigung einzelner (in der nachstehenden Tabelle nummerierter) wichtigster nachteiliger Auswirkungen (PAI) drückt sich darin aus, dass der Teilfonds niedrigere Werte als der Referenzwert aufweist. Die bei der Berechnung der PAI-Werte verwendeten Daten stammen von externen Datenanbietern. Sie können auf Unternehmensangaben basieren oder von den Datenanbietern geschätzt werden, wo keine solchen Angaben vorliegen. Bitte beachten Sie, dass es nicht immer möglich ist, die Richtigkeit, Aktualität oder Vollständigkeit der von Drittanbietern bereitgestellten Daten zu garantieren.

Der Referenzwert wurde zur Messung der Kohlenstoffintensität und Festlegung des ESG-Rating herangezogen, diente aber nicht der Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale des Teilfonds.

Das Abschneiden der Nachhaltigkeitsindikatoren, die der Teilfonds zur Messung der Erreichung der von ihm beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet, ist in der folgenden Tabelle dargestellt.

Alle Unternehmen/Emittenten haben eine gute Unternehmensführung bewiesen, was sich am PAI-Score 10 unten ablesen lässt.

### **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

| <b>Indikator</b>   | <b>Teilfonds</b> | <b>Referenzwert</b> |
|--|------------------|---------------------|
| ESG-Score  | 6,27             | 5,56                |
| E-Säule  | 6,24             | 5,68                |
| S-Säule  | 5,30             | 5,33                |
| G-Säule  | 5,41             | 5,31                |
| 1. THG-Emissionen – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente  | 463,36           | 14.880.900,00       |
| 2. CO <sub>2</sub> -Fußabdruck – Tonnen CO <sub>2</sub> pro Million Euro (EVIC)  | 13,98            | 38,51               |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente pro Million Euro Umsatz | 80,20            | 233,09              |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze   | 1,42 %           | 1,29 %              |

der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen

|  |        |        |
|--|--------|--------|
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) | 1,24 % | 2,02 % |
|--|--------|--------|

Die Daten in diesem regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung beziehen sich auf den Stand vom 31. März 2024, basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des am 31. März 2024 endenden Geschäftsjahres.

Referenzwert - J.P. Morgan ESG Asia Credit Index

### **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

| Indikator  | Zeitraum zum  | Teilfonds | Referenzwert  |
|--|---------------|-----------|---------------|
| ESG-Score  | 31. März 2024 | 6,27      | 5,56          |
|  | 31. März 2023 | 6,09      | 5,31          |
| E-Säule  | 31. März 2024 | 6,24      | 5,68          |
|  | 31. März 2023 | 5,75      | 5,33          |
| S-Säule  | 31. März 2024 | 5,30      | 5,33          |
|  | 31. März 2023 | 5,12      | 5,28          |
| G-Säule  | 31. März 2024 | 5,41      | 5,31          |
|  | 31. März 2023 | 5,18      | 4,98          |
| 1. THG-Emissionen – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente  | 31. März 2024 | 463,36    | 14.880.900,00 |
|  | 31. März 2023 | 505,68    | 14.170.000,00 |
| 2. CO <sub>2</sub> -Fußabdruck – Tonnen CO <sub>2</sub> pro Million Euro (EVIC)  | 31. März 2024 | 13,98     | 38,51         |
|  | 31. März 2023 | 12,11     | 34,03         |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente pro Million Euro Umsatz   | 31. März 2024 | 80,20     | 233,09        |
|  | 31. März 2023 | 81,24     | 202,48        |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 31. März 2024 | 1,42 %    | 1,29 %        |
|  | 31. März 2023 | 0,80 %    | 1,77 %        |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 31. März 2024 | 1,24 %    | 2,02 %        |
|  | 31. März 2023 | 0,00 %    | 0,17 %        |

Da es sich erst um den zweiten regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung handelt, ist kein Vergleich mit vorangegangenen Zeiträumen möglich.

### **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die vom Teilfonds getätigten nachhaltigen Investitionen trugen unter anderem zu folgenden ökologischen Zielen bei:

1. Reduzierung von Treibhausgasemissionen und Verringerung des CO<sub>2</sub>-Fußabdrucks;
2. Übergang zu oder die Nutzung von erneuerbarer Energie.

Die Portfoliokonstruktion des Teilfonds zielte auf ein geringeres Engagement in kohlenstoffintensiven Unternehmen und die Verbesserung des Gesamt-ESG-Score gegenüber dem Referenzwert ab.

***Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?***

Wir bestätigen, dass wir nachhaltige Vermögenswerte darauf geprüft haben, ob sie erhebliche Beeinträchtigungen verursachen können. Dies erfolgte im Rahmen des Standard-Anlageprozesses von HSBC Asset Management (HSBC) und unter Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen.

*Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?*

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 Anlageberater hat alle durch die Offenlegungsverordnung definierten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI) auf ihre Relevanz für den Teilfonds geprüft. Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren legt fest, wie HSBC die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen identifiziert und darauf reagiert, und in welcher Form HSBC Nachhaltigkeitsrisiken berücksichtigt, die sich negativ auf Wertpapiere auswirken können, in die der Teilfonds investiert. HSBC identifizierte in Zusammenarbeit mit externen Screening-Dienstleistern, wie Sustainalytics, ISS, MSCI und Trucost, Unternehmen und Regierungen mit schlechter Bilanz beim Management von ESG-Risiken, und wo solche wesentlichen Risiken identifiziert wurden, führte HSBC zusätzliche ESG-Due-Diligence-Prüfungen durch. Durch Screening identifizierte Nachhaltigkeitsauswirkungen einschließlich der PAI bildeten einen Schlüsselfaktor beim Anlageentscheidungsprozess.

Der oben beschriebene Ansatz führte dazu, dass unter anderem folgende Faktoren geprüft wurden:

- Engagement der Unternehmen für den Übergang zu CO<sub>2</sub>-armen Wirtschaften, zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern, Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus großen Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails; und
- Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit folgenden Bereichen: demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.

Die spezifischen PAI für diesen Teilfonds waren wie unten beschrieben.

Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren ist auf der Website [www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies](http://www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies) verfügbar.

*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:*

HSBC hat sich der Anwendung und Förderung globaler Standards verpflichtet. Die wichtigsten Schwerpunktbereiche der Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren entsprachen den zehn UNGC-Grundsätzen. Diese Grundsätze stehen in Zusammenhang mit nicht finanziellen Risiken in den Bereichen Menschenrechte, Arbeit, Umweltschutz und Korruptionsbekämpfung. HSBC gehört darüber hinaus zu den Unterzeichnern der UN Principles for Responsible Investment. Diese bildeten den Rahmen für Ermittlung und Management von Nachhaltigkeitsrisiken beim Investmentansatz von HSBC.

Von Unternehmen, in die der Teilfonds investierte, wurde erwartet, dass sie die Anforderungen des UNGC und der damit verbundenen Standards erfüllen. Unternehmen, die belegbar gegen einen der zehn Grundsätze des UNGC verstießen, wurden systematisch ausgeschlossen. Der Teilfonds führte verstärkte Due-Diligence-Prüfungen bei Unternehmen durch, die als nicht konform mit den Prinzipien des UNGC angesehen wurden oder die nach den unternehmenseigenen ESG Ratings von HSBC als risikoreich angesehen wurden. Darüber hinaus wurden die Unternehmen nach internationalen Standards wie den OECD-Leitsätzen bewertet.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen. Hierbei gelten spezifische von der Union definierte Kriterien.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*



## **Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Der Teilfonds berücksichtigte die folgenden PAI, indem er sie als Nachhaltigkeitsindikatoren beobachtete:

- Treibhausgasemissionen (Scope 1 und Scope 2)
- CO<sub>2</sub>-Fußabdruck (Scope 1 und Scope 2)
- Treibhausgasintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1 und Scope 2)
- Verstöße gegen die UNGC- und OECD-Grundsätze
- Anteil der Investitionen mit Beteiligung an umstrittenen Waffen

Der Ansatz zur Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen beinhaltete unter anderem, dass HSBC das Engagement der Unternehmen für den Übergang zu kohlenstoffarmem Wirtschaften, die zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern sowie die Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette prüfte, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der



Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails. Ebenfalls berücksichtigt wurde das Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit den Bereichen demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.

Das Screening führte dazu, dass HSBC nicht in bestimmte Unternehmen und Emittenten investierte.



## Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der Investitionen** entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden: basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des Bezugszeitraums zum 31.03.2024

| Größte Investitionen   | Sektor                         | % der Vermögenswerte | Land  |
|--|--------------------------------|----------------------|---|
| Bangkok Bank Pic (Hong Kong Branch) 9,025 % 15.03.2029         | Finanzen                       | 1,94 %               | Thailand  |
| HSBC US Dollar Liquidity Y 10116567                            | Andere                         | 1,40 %               | Irland  |
| Oversea-Chinese Banking Corporation Limited 1,832 % 10.09.2030 | Finanzen                       | 1,29 %               | Singapur  |
| Prudential Plc 2,95 % 03.11.2033                               | Finanzen                       | 1,17 %               | Hongkong  |
| Kookmin Bank Co.,Ltd. 7,0306 % Perp                            | Finanzen                       | 1,11 %               | Korea   |
| Government Of Indonesia 4,625 % 15.04.2043                     | Staatsanleihen                 | 1,08 %               | Indonesien  |
| Standard Chartered Plc 2,678 % 29.06.2032                      | Finanzen                       | 1,08 %               | Vereinigtes Königreich von Großbritannien und Nordirland. |
| Pt Pertamina (persero) 6,5 % 27.05.2041                        | Energie                        | 1,07 %               | Indonesien  |
| Hkt Capital No. 5 Ltd. 3,25 % 30.09.2029                       | Kommunikationsdienstleistungen | 1,03 %               | Hongkong  |
| TSMC Global Ltd. 0,75 % 28.09.2025                             | Informationstechnologie        | 1,03 %               | Taiwan  |
| Aia Group Limited 2,7 % Perp                                   | Finanzen                       | 1,02 %               | Hongkong  |
| Keb Hana Bank 3,25 % 30.03.2027                                | Finanzen                       | 0,98 %               | Korea   |
| Renew Power Private Limited 5,875 % 05.03.2027                 | Versorger                      | 0,94 %               | Indien  |
| Zhongsheng Group Holdings Ltd. 3,0 % 13.01.2026                | Zyklische Konsumgüter          | 0,94 %               | China   |
| Dbz Group Holdings Ltd 3,3 % Perp                              | Finanzen                       | 0,93 %               | Singapur  |

Barmittel und Derivate wurden nicht berücksichtigt

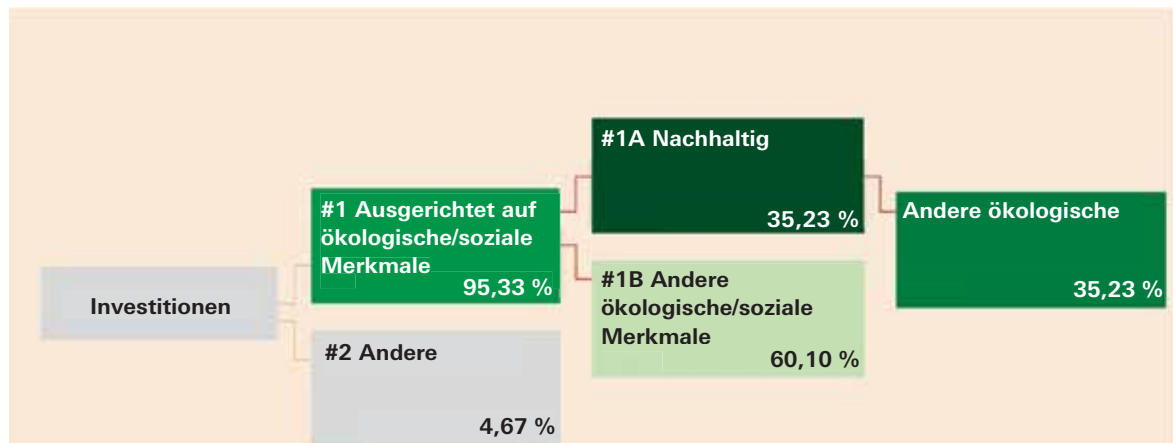


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

35,23 % des Portfolios waren in nachhaltige Vermögenswerte investiert.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?



**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**#2 Andere Investitionen** umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

### In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

| Sektor / Teilsektor                                   | % der Vermögenswerte |
|---|----------------------|
| Finanzen  | 35,05 %              |
| Andere  | 17,65 %              |
| Staatsanleihen  | 10,96 %              |
| Immobilien  | 7,46 %               |
| Industriegüter  | 5,73 %               |
| Versorger   | 5,70 %               |
| <i>Stromversorgungsbetriebe</i>                       | 0,16 %               |
| <i>Erdgas</i>   | 0,81 %               |
| <i>Unabhängige Stromerzeuger und Energiehändler</i>   | 1,58 %               |
| Kommunikationsdienstleistungen                        | 5,54 %               |
| Zyklische Konsumgüter                                 | 4,49 %               |
| Informationstechnologie                               | 3,33 %               |
| Energie   | 1,74 %               |
| <i>Ausrüstung und Dienstleistungen für Öl und Gas</i> | 0,79 %               |
| <i>Exploration und Produktion von Öl und Gas</i>      | 0,72 %               |
| <i>Raffination und Vertrieb von Öl und Gas</i>        | 0,23 %               |
| Basiskonsumgüter                                      | 1,33 %               |
| Grundstoffe   | 0,79 %               |
| Barmittel und Derivate                                | 0,24 %               |
| Summe   | 100,00 %             |

Mit Blick auf die EU-Taxonomie-konformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

**Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



## Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

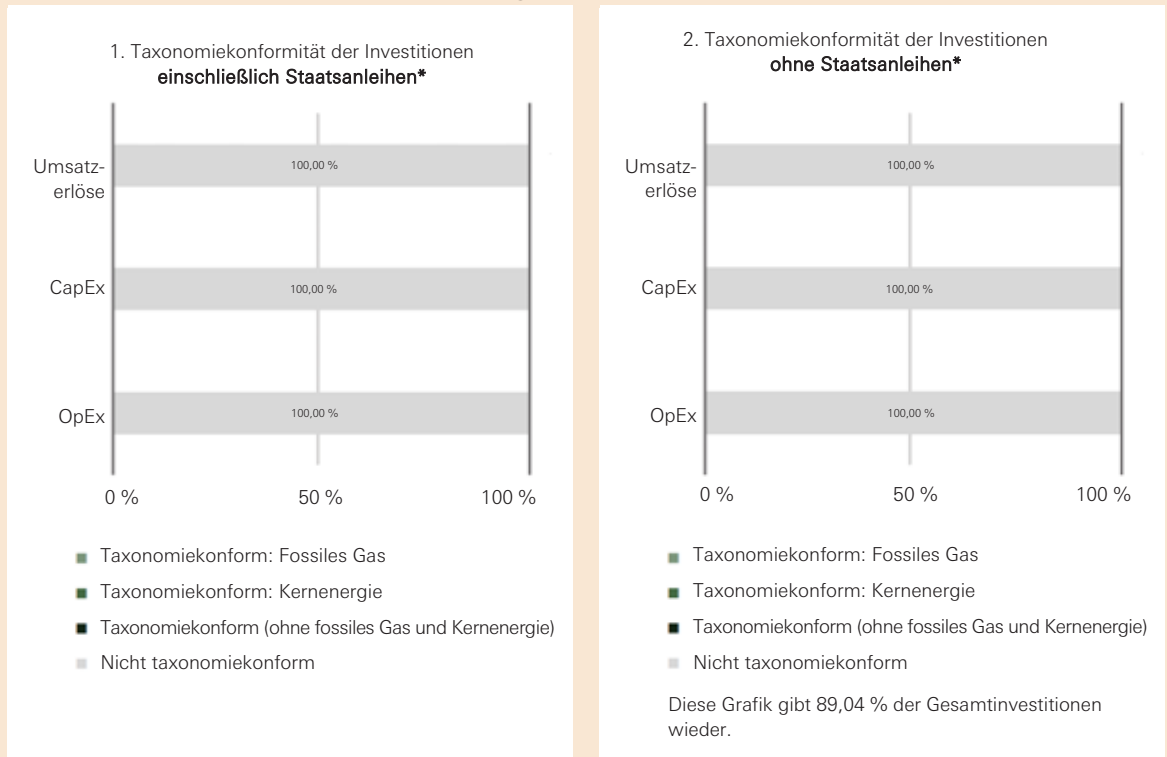
Der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen lag bei 0 %. Der Teilfonds hat sich nicht verpflichtet, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen.

### Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

Ja:  
 In fossiles Gas     In Kernenergie  
 Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

**Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.**



\* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**


Im Referenzzeitraum betrug der Anteil der Investitionen des Fonds, die in Übergangstätigkeiten geflossen sind, 0,00 % und der Anteil der Investitionen, die in ermöglichende Tätigkeiten geflossen ist, 0,00 %.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

| Indikator   | 2023-2024 | 2022-2023 |
|---|-----------|-----------|
| Umsatz – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                       | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform: Kernenergie                        | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie) | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Nicht taxonomiekonform                               | 100,00 %  | 100,00 %  |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                        | n. z.     | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                         | n. z.     | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)  | n. z.     | 0,00 %    |
| CAPEX – Nicht taxonomiekonform                                | 100,00 %  | 100,00 %  |
| OPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                         | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                          | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)   | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Nicht taxonomiekonform                                 | 100,00 %  | 100,00 %  |

Da es sich erst um den zweiten Berichtszeitraum des Teilfonds handelt, ist ein Vergleich mit der Zeit davor nicht erforderlich.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.


 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?**

Der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel war 35,23 %. Der Teilfonds hat sich nicht verpflichtet, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen.

 **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Teilfonds investierte nicht in sozial nachhaltige Anlagen.

 **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

#2 Andere Investitionen umfasst die Finanzinstrumente, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden. In manchen Fällen ist dies auf die Nichtverfügbarkeit von Daten und Unternehmensmaßnahmen zurückzuführen. Diese Positionen unterlagen nach wie vor dem vollständigen Ausschluss-Screening von HSBC und wurden im Hinblick auf verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Prinzipien des UNGC und der OECD geprüft.

Der Teilfonds hielt Barmittel / Barmitteläquivalente (der Prozentsatz der gehaltenen Barmittel ist in der obigen Tabelle der Sektoren/Teilsektoren unter der Überschrift „In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?“ ersichtlich) zum Zwecke des Liquiditätsmanagements sowie derivative Finanzinstrumente zum Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements. Barmittel / Barmitteläquivalente und derivative Finanzinstrumente verfügen aufgrund der Art dieser Instrumente über keinen ökologischen oder sozialen Mindestschutz.



## Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Im Laufe des Berichtszeitraums schloss der Anlageberater unter anderem verbotene Waffen, umstrittene Waffen, Unternehmen, die mehr als 10 % ihres Umsatzes aus Kraftwerkskohle und Energieerzeugung aus Kohle generieren, und Tabakherstellung aus und investierte in Unternehmen mit verantwortungsvollen Geschäftspraktiken gemäß den Prinzipien des UNGC.

Die ESG-Analyse war in die Fundamentaldatenanalyse der Anleihen, in die der Teilfonds investierte, eingebettet und floss daher mit in alle Handelsgeschäfte ein. Die Handelsgeschäfte spiegelten eine ausgewogene Integration finanzieller und nichtfinanzieller Kriterien wider. Der Teilfonds bevorzugte weiterhin ESG-freundliche Sektoren, darunter den indischen Sektor für erneuerbare Energien und auch den Finanzsektor in ausgewählten Ländern mit stabilen Fundamentaldaten und soliden ESG-Scores und Governance-Praktiken. Während des Berichtszeitraums erzielte der Teilfonds weiterhin einen höheren ESG-Score als der Referenzwert (>10 %) und eine niedrigere Kohlenstoffintensität im Vergleich zum Referenzwert (mehr als 20 % niedriger). Der Teilfonds investiert in gekennzeichnete Anleihen, einschließlich grüner Anleihen, nachhaltiger Anleihen usw., um die nachhaltigen Investitionsziele zu erreichen.

Wurden außerdem wesentliche ESG-Risiken oder ein potenzieller Verstoß gegen einen oder mehrere der 10 Global Prinzipien des UN festgestellt, führte der Portfoliomanager/Analyst eine intensive Due-Diligence-Prüfung in Bezug auf ESG-Themen durch und musste die Genehmigung des Investitionsausschusses einholen, bevor Investitionen getätigt werden konnten.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend.

### ● **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Nicht zutreffend.

### ● **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?**

Nicht zutreffend.

### ● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

### ● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen 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.

Name des Produkts: HSBC GLOBAL INVESTMENT FUNDS - EURO BOND

Unternehmenskennung (LEI-Code): QCWW2LDBI4BRGCNZ8497

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

| <input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> Ja   | <input type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> Nein   |
|---|---|
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt</b> : _ %<br><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit <b>ökologische/soziale Merkmale beworben</b> und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 27,98 % an nachhaltigen Investitionen<br><input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel |
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel</b> getätigt: _ %   | <input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine <b>nachhaltigen Investitionen getätigt</b>   |



### Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Während des Geschäftsjahres zum 31. März 2024 (der Bezugszeitraum) bewarb der Teilfonds die folgenden Merkmale:

1. Der Teilfonds prüfte und analysierte alle Unternehmen oder Emittenten im Hinblick auf ökologische Merkmale, insbesondere physische Risiken durch den Klimawandel und Personalmanagement. Für die zugrunde liegenden E-, S- und G-Säulen wurden ein Screening sowie ein Vergleich mit dem für den Teilfonds definierten

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Referenzwert durchgeführt. „E“ und „S“ spiegeln die einzelnen Elemente der vom Teilfonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale wider, „G“ die Unternehmensführungspraktiken, die die Interessen von Minderheitsaktionären schützen und eine langfristige nachhaltige Wertschöpfung fördern.

2. Der Teilfonds berücksichtigte verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Grundsätzen des Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC) und den Leitsätzen für multinationale Unternehmen der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für Unternehmen. Wurden potenzielle Verstöße gegen die Prinzipien des UNGC festgestellt, wurden die Emittenten einer eigenen Due-Diligence-Prüfung hinsichtlich ESG-Themen unterzogen, um festzustellen, ob sie für die Aufnahme in das Portfolio des Teilfonds geeignet sind, und sie auszuschließen, falls sie als ungeeignet erachtet wurden.

3. Der Teilfonds schloss als umweltschädlich eingestufte Geschäftsaktivitäten aus, wie Kraftwerkskohle und Energieerzeugung aus Kohle.

4. Der Teilfonds berücksichtigte aktiv ökologische und soziale Aspekte, indem er über unsere Engagement- und Stewardship-Teams Mitwirkung bei Emittenten umsetzte, wo HSBC Asset Management dies für angemessen hielt.

5. Der Teilfonds schloss nach entsprechender Analyse Anlagen in umstrittenen Waffen aus.

Der ESG-Score stammt vom externen ESG-Datenanbieter MSCI. Die Berücksichtigung einzelner (in der nachstehenden Tabelle nummerierter) wichtigster nachteiliger Auswirkungen (PAI) drückt sich im Vergleich zum Referenzwert aus. Die bei der Berechnung der PAI-Werte verwendeten Daten stammen von externen Datenanbietern. Sie können auf Unternehmensangaben basieren oder von den Datenanbietern geschätzt werden, wo keine solchen Angaben vorliegen. Bitte beachten Sie, dass es nicht immer möglich ist, die Richtigkeit, Aktualität oder Vollständigkeit der von Drittanbietern bereitgestellten Daten zu garantieren.

Der Referenzwert für den Teilfonds wurde zur Beurteilung des ESG-Rating des Teilfonds angewandt. Das ESG-Rating des Teilfonds errechnet sich aus dem Vergleich des gewichteten Durchschnitts der ESG-Ratings der Emittenten des Teilfonds und dem gewichteten Durchschnitt der Bestandteile des Referenzwerts. Der Referenzwert diente jedoch nicht der Erreichung der vom Teilfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale.

Das Abschneiden der Nachhaltigkeitsindikatoren, die der Teilfonds zur Messung der Erreichung der von ihm beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet, ist in der folgenden Tabelle dargestellt. Es wurde auf das Erreichen eines ESG-Score des Teilfonds hingearbeitet, der über dem vom Teilfonds ausgewählten Referenzindex liegt (ein höherer Score als der Referenzwert bedeutet bessere ESG-Referenzen).

Alle Emittenten wiesen Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung vor, die sich durch den unten aufgeführten PAI 10-Score ausdrücken

### **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

| <b>Indikator</b>   | <b>Teilfonds</b> | <b>Referenzwert</b> |
|--|------------------|---------------------|
| ESG-Score  | 7,43             | 6,79                |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente pro Million Euro Umsatz   | 99,29            | 79,89               |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 0,00 %           | 0,09 %              |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 0,00 %           | 0,03 %              |

|  |        |        |
|--|--------|--------|
| 15. THG-Emissionsintensität - Kennzahl in Kilotonnen pro BIP-Einheit (in Millionen Euro) | 271,08 | 282,09 |
|--|--------|--------|

Die Daten in diesem regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung beziehen sich auf den Stand vom 31. März 2024, basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des am 31. März 2024 endenden Geschäftsjahres.

Referenzwert – Bloomberg Euro Aggregate

### **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

| <b>Indikator</b>   | <b>Zeitraum zum</b> | <b>Teilfonds</b> | <b>Referenzwert</b> |
|--|---------------------|------------------|---------------------|
| ESG-Score  | 31. März 2024       | 7,43             | 6,79                |
|  | 31. März 2023       | 7,36             | 6,66                |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente pro Million Euro Umsatz   | 31. März 2024       | 99,29            | 79,89               |
|  | 31. März 2023       | 104,49           | 101,71              |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 31. März 2024       | 0,00 %           | 0,09 %              |
|  | 31. März 2023       | 0,00 %           | 0,12 %              |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 31. März 2024       | 0,00 %           | 0,03 %              |
|  | 31. März 2023       | 0,00 %           | 0,00 %              |
| 15. THG-Emissionsintensität - Kennzahl in Kilotonnen pro BIP-Einheit (in Millionen Euro)   | 31. März 2024       | 271,08           | 282,09              |
|  | 31. März 2023       | 136,90           | 150,89              |

Da es sich erst um den zweiten regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung handelt, ist kein Vergleich mit vorangegangenen Zeiträumen möglich.

### **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die vom Teilfonds getätigten nachhaltigen Investitionen trugen unter anderem zu folgenden ökologischen Zielen bei:

1. Reduzierung von Treibhausgasemissionen und Verringerung des CO<sub>2</sub>-Fußabdrucks;
2. Übergang zu oder die Nutzung von erneuerbarer Energie.

Der Teilfonds identifizierte und analysierte ESG-Referenzen eines Unternehmens als wesentlichen Bestandteil des Anlageentscheidungsprozesses zur Reduzierung von Nachhaltigkeitsrisiken und zur Steigerung der Renditen. Der Anlageberater zielt darauf ab, durch Berücksichtigung der ESG-Referenzen potenzieller Investitionen einen besseren ESG-Score zu erzielen als der Referenzwert.

### **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Wir bestätigen, dass wir nachhaltige Vermögenswerte darauf geprüft haben, ob sie erhebliche Beeinträchtigungen verursachen können. Dies erfolgte im Rahmen des Standard-Anlageprozesses von HSBC Asset Management (HSBC) und unter Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen.



## *Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?*

Der Anlageberater hat alle durch die Offenlegungsverordnung definierten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI) auf ihre Relevanz für den Teilfonds geprüft. Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren legt fest, wie HSBC die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen identifiziert und darauf reagiert, und in welcher Form HSBC Nachhaltigkeitsrisiken berücksichtigt, die sich negativ auf Wertpapiere auswirken können, in die der Teilfonds investiert. HSBC identifizierte in Zusammenarbeit mit externen Screening-Dienstleistern, wie Sustainalytics, ISS, MSCI und Trucost, Unternehmen und Regierungen mit schlechter Bilanz beim Management von ESG-Risiken, und wo solche wesentlichen Risiken identifiziert wurden, führte HSBC zusätzliche ESG-Due-Diligence-Prüfungen durch. Durch Screening identifizierte Nachhaltigkeitsauswirkungen einschließlich der PAI bildeten einen Schlüsselfaktor beim Anlageentscheidungsprozess.

Der oben beschriebene Ansatz führte dazu, dass unter anderem folgende Faktoren geprüft wurden:

- Engagement der Unternehmen für den Übergang zu CO2-armen Wirtschaften, zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern, Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus großen Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails; und
- Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit folgenden Bereichen: demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.

Die spezifischen PAI für diesen Teilfonds waren wie unten beschrieben.

Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren ist auf der Website [www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies](http://www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies) verfügbar.

*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:*

HSBC hat sich der Anwendung und Förderung globaler Standards verpflichtet. Die wichtigsten Schwerpunktbereiche der Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren entsprachen den zehn UNGC-Grundsätzen. Diese Grundsätze stehen in Zusammenhang mit nicht finanziellen Risiken in den Bereichen Menschenrechte, Arbeit, Umweltschutz und Korruptionsbekämpfung. HSBC gehört darüber hinaus zu den Unterzeichnern der UN Principles for Responsible Investment. Diese bildeten den Rahmen für Ermittlung und Management von Nachhaltigkeitsrisiken beim Investmentansatz von HSBC.

### **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.

Von Unternehmen, in die der Teilfonds investierte, wurde erwartet, dass sie die Anforderungen des UNGC und der damit verbundenen Standards erfüllen. Unternehmen, die belegbar gegen einen der zehn Grundsätze des UNGC verstießen, wurden systematisch ausgeschlossen. Der Teilfonds führte verstärkte Due-Diligence-Prüfungen bei Unternehmen durch, die als nicht konform mit den Prinzipien des UNGC angesehen wurden oder die nach den unternehmenseigenen ESG Ratings von HSBC als risikoreich angesehen wurden. Darüber hinaus wurden die Unternehmen nach internationalen Standards wie den OECD-Leitsätzen bewertet.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen. Hierbei gelten spezifische von der Union definierte Kriterien.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*



### **Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Die vom Teilfonds berücksichtigte wichtigste nachteilige Auswirkungen waren:

- Treibhausgasintensität von staatlichen Emittenten
- Treibhausgasintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1 und Scope 2)
- Verstöße gegen die UNGC- und OECD-Grundsätze
- Anteil der Investitionen mit Beteiligung an umstrittenen Waffen

Der Ansatz zur Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen beinhaltete unter anderem, dass HSBC das Engagement der Unternehmen für den Übergang zu kohlenstoffarmem Wirtschaften, die zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern sowie die Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette prüfte, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails. Ebenfalls berücksichtigt wurde das Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit den Bereichen demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.

Das Screening führte dazu, dass HSBC nicht in bestimmte Unternehmen und Emittenten investierte.



## Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der Investitionen** entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden: basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des Bezugszeitraums zum 31.03.2024

| Größte Investitionen                                  | Sektor         | % der Land Vermögenwerte |
|---|----------------|--------------------------|
| Government Of Italy 2,8 %<br>01.12.2028               | Staatsanleihen | 5,43 % Italien           |
| Government Of France 4,75 %<br>25.04.2035             | Staatsanleihen | 4,87 % Frankreich        |
| Government Of Belgium 1,9 %<br>22.06.2038             | Staatsanleihen | 3,03 % Belgien           |
| Government Of Belgium 2,6 %<br>22.06.2024             | Staatsanleihen | 2,79 % Belgien           |
| Axa Home Loan Sfh 0,01 %<br>16.10.2029                | Finanzen       | 2,32 % Frankreich        |
| Government Of Luxembourg 0,0 %<br>28.04.2030          | Staatsanleihen | 2,18 % Luxemburg         |
| KfW 0,01 % 05.05.2027                                 | Staatsanleihen | 2,03 % Deutschland       |
| European Investment Bank 0,125 %<br>15.04.2025        | Staatsanleihen | 1,96 % SUPRANATIONAL     |
| Government Of Italy 5,0 %<br>01.09.2040               | Staatsanleihen | 1,90 % Italien           |
| Government Of Italy 6,0 %<br>01.05.2031               | Staatsanleihen | 1,84 % Italien           |
| Government Of The Netherlands 4,0 %<br>15.01.2037     | Staatsanleihen | 1,81 % Niederlande       |
| Agence Francaise De Developpement 0,5 %<br>31.10.2025 | Finanzen       | 1,76 % Frankreich        |
| Government Of Spain 1,85 %<br>30.07.2035              | Staatsanleihen | 1,66 % Spanien           |
| Government Of Italy 1,35 %<br>01.04.2030              | Staatsanleihen | 1,62 % Italien           |
| European Union 0,125 %<br>10.06.2035                  | Staatsanleihen | 1,60 % SUPRANATIONAL     |

Barmittel und Derivate wurden nicht berücksichtigt

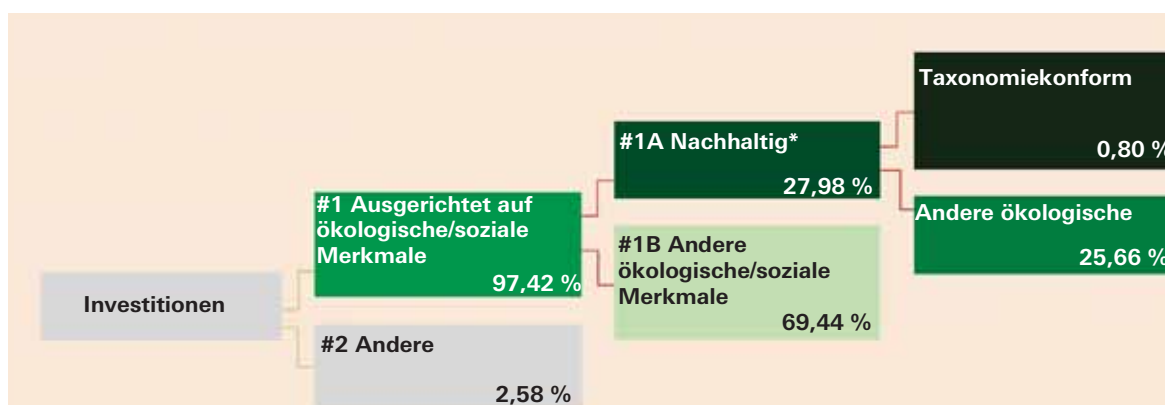


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

27,98 % des Portfolios waren in nachhaltige Vermögenswerte investiert.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?



**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**#2 Andere Investitionen** umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien.

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

\* Ein Unternehmen oder Emittent, das bzw. der als nachhaltige Investition angesehen wird, kann sowohl zu einem sozialen als auch zu einem ökologischen Ziel beitragen, das an der EU-Taxonomie ausgerichtet sein kann oder nicht. Die Zahlen in der obigen Grafik berücksichtigen dies. Jedoch darf eine Gesellschaft oder ein Emittent unter dem Punkt der nachhaltigen Investitionen (#1A Nachhaltige Investitionen) nur einmal erfasst werden.

Die Prozentzahlen von taxonomiekonformen Investitionen und Andere ökologische Merkmale stimmen aufgrund der unterschiedlichen Berechnungsmethoden für nachhaltige Investitionen und taxonomiekonforme Investitionen nicht mit #1A Nachhaltige Investitionen überein.

## In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

| Sektor / Teilsektor                    | % der Vermögenswerte |
|--|----------------------|
| Staatsanleihen                         | 57,14 %              |
| Finanzen                               | 18,61 %              |
| Versorger                              | 7,29 %               |
| <i>Stromversorgungsbetriebe</i>        | 4,68 %               |
| <i>Multi-Versorger</i>                 | 2,61 %               |
| Andere                                 | 5,97 %               |
| Gesundheitswesen                       | 1,88 %               |
| Kommunikationsdienstleistungen         | 1,75 %               |
| Grundstoffe                            | 1,50 %               |
| Immobilien                             | 1,48 %               |
| Energie                                | 1,22 %               |
| <i>Integrierter Öl- und Gaskonzern</i> | 1,22 %               |
| Basiskonsumgüter                       | 1,01 %               |
| Zyklische Konsumgüter                  | 0,94 %               |
| Industriegüter                         | 0,81 %               |
| Barmittel und Derivate                 | 0,40 %               |
| Summe                                  | 100,00 %             |



Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

## Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

Der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen ist in den obigen Feldern zur Vermögensallokation ersichtlich.

### Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

Ja:  
 In fossiles Gas       In Kernenergie  
 Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

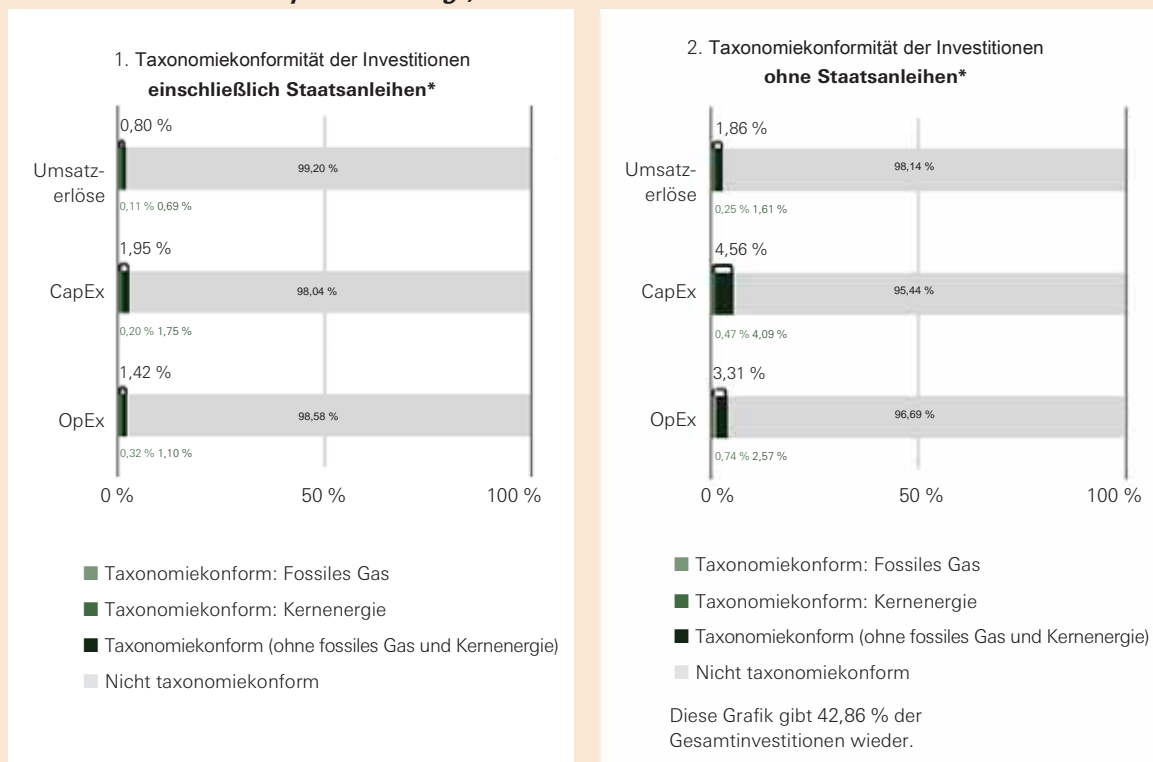
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen.

- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

**Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

**Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-Taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.**



\* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

**Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Im Referenzzeitraum betrug der Anteil der Investitionen des Fonds, die in Übergangstätigkeiten geflossen sind, 0,11 % und der Anteil der Investitionen, die in ermöglichende Tätigkeiten geflossen ist, 0,46 %.

**Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

| Indikator   | 2023-2024 | 2022-2023 |
|---|-----------|-----------|
| Umsatz – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                       | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform: Kernenergie                        | 0,11 %    | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie) | 0,69 %    | 0,00 %    |
| Umsatz – Nicht taxonomiekonform                               | 99,20 %   | 100,00 %  |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                        | n. z.     | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                         | 0,20 %    | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)  | 1,75 %    | 0,00 %    |
| CAPEX – Nicht taxonomiekonform                                | 98,04 %   | 100,00 %  |
| OPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                         | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                          | 0,32 %    | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)   | 1,10 %    | 0,00 %    |
| OPEX – Nicht taxonomiekonform                                 | 98,58 %   | 100,00 %  |

Da es sich erst um den zweiten Berichtszeitraum des Teilfonds handelt, ist ein Vergleich mit der Zeit davor nicht erforderlich.



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?

Der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel war 25,66 %. Der Teilfonds hat sich nicht verpflichtet, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen.



## Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Teilfonds investierte nicht in sozial nachhaltige Anlagen.



## Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

#2 Andere Investitionen umfasst die Finanzinstrumente, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden. In manchen Fällen ist dies auf die Nichtverfügbarkeit von Daten und Unternehmensmaßnahmen zurückzuführen. Diese Positionen unterlagen nach wie vor dem vollständigen Ausschluss-Screening von HSBC und wurden im Hinblick auf verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Prinzipien des UNGC und der OECD geprüft.

Der Teilfonds hielt Barmittel / Barmitteläquivalente (der Prozentsatz der gehaltenen Barmittel ist in der obigen Tabelle der Sektoren/Teilektoren unter der Überschrift „In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?“ ersichtlich) zum Zwecke des Liquiditätsmanagements sowie derivative Finanzinstrumente zum Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements. Barmittel / Barmitteläquivalente und derivative Finanzinstrumente verfügen aufgrund der Art dieser Instrumente über keinen ökologischen oder sozialen Mindestschutz.



## Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Im Laufe des Berichtszeitraums schloss der Anlageberater unter anderem verbotene Waffen, umstrittene Waffen, Unternehmen, die mehr als 10 % ihres Umsatzes aus Kraftwerkskohle und Energieerzeugung aus Kohle generieren, und Tabakherstellung aus und investierte in Unternehmen mit verantwortungsvollen Geschäftspraktiken gemäß den Prinzipien des UNGC.

Alle Positionen des Portfolios wurden hinsichtlich ihrer individuellen Treibhausgasintensität bewertet, was zu PAI-Scores führte, die im Einklang mit denen des Referenzwerts lagen. Der Teilfonds bewertete auch ESG-Scores mit dem Ergebnis, dass der ESG-Score während des gesamten Berichtszeitraums über dem des Referenzwerts lag.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Nicht zutreffend.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Nicht zutreffend.

- **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?**

Nicht zutreffend.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

Name des Produkts: HSBC GLOBAL INVESTMENT FUNDS - EURO CREDIT BOND

Unternehmenskennung (LEI-Code): 549300R35ZWT4M8NDL73

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen 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?   |  |
|---|--|
| ●● <input type="checkbox"/> Ja  | ●● <input checked="" type="checkbox"/> Nein  |
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel</b> getätigt: _ % <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> </ul> | <input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit <b>ökologische/soziale Merkmale</b> beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 32,95 % an nachhaltigen Investitionen <ul style="list-style-type: none"> <li><input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel</li> </ul> |
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel</b> getätigt: _ %   | <input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>ökologische/soziale Merkmale</b> beworben, aber keine <b>nachhaltigen Investitionen</b> getätigt   |



### Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Während des Geschäftsjahres zum 31. März 2024 (der Bezugszeitraum) bewarb der Teilfonds die folgenden Merkmale:

- Der Teilfonds prüfte und analysierte alle Unternehmen oder Emittenten im Hinblick auf ökologische Merkmale, insbesondere physische Risiken durch den Klimawandel und Personalmanagement. Für die zugrunde liegenden E-, S- und G-Säulen wurden ein Screening sowie ein Vergleich mit dem für den Teilfonds definierten



Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Referenzwert durchgeführt. „E“ und „S“ spiegeln die einzelnen Elemente der vom Teilfonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale wider, „G“ die Unternehmensführungspraktiken, die die Interessen von Minderheitsaktionären schützen und eine langfristige nachhaltige Wertschöpfung fördern.

2. Der Teilfonds berücksichtigte verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Grundsätzen des Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC) und den Leitsätzen für multinationale Unternehmen der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für Unternehmen. Wurden potenzielle Verstöße gegen die Prinzipien des UNGC festgestellt, wurden die Emittenten einer eigenen Due-Diligence-Prüfung hinsichtlich ESG-Themen unterzogen, um festzustellen, ob sie für die Aufnahme in das Portfolio des Teilfonds geeignet sind, und sie auszuschließen, falls sie als ungeeignet erachtet wurden.

3. Der Teilfonds schloss als umweltschädlich eingestufte Geschäftsaktivitäten aus, wie Kraftwerkskohle und Energieerzeugung aus Kohle.

4. Der Teilfonds berücksichtigte aktiv ökologische und soziale Aspekte, indem er über unsere Engagement- und Stewardship-Teams Mitwirkung bei Emittenten umsetzte, wo HSBC Asset Management dies für angemessen hielt.

5. Der Teilfonds schloss nach entsprechender Analyse Anlagen in umstrittenen Waffen aus.

Die ESG-Scores stammen vom externen ESG-Datenanbieter MSCI. Die Berücksichtigung einzelner (in der nachstehenden Tabelle nummerierter) wichtigster nachteiliger Auswirkungen (PAI) drückt sich im Vergleich zum Referenzwert aus. Die bei der Berechnung der PAI-Werte verwendeten Daten stammen von externen Datenanbietern. Sie können auf Unternehmensangaben basieren oder von den Datenanbietern geschätzt werden wo keine solchen Angaben vorliegen. Bitte beachten Sie, dass es nicht immer möglich ist, die Richtigkeit, Aktualität oder Vollständigkeit der von Drittanbietern bereitgestellten Daten zu garantieren.

Der Referenzwert für den Teilfonds wurde zur Beurteilung des ESG-Rating des Teilfonds angewandt. Das ESG-Rating des Teilfonds errechnet sich aus dem Vergleich des gewichteten Durchschnitts der ESG-Ratings der Emittenten des Teilfonds und dem gewichteten Durchschnitt der Bestandteile des Referenzwerts. Der Referenzwert diente jedoch nicht der Erreichung der vom Teilfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale.

Das Abschneiden der Nachhaltigkeitsindikatoren, die der Teilfonds zur Messung der Erreichung der von ihm beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet, ist in der folgenden Tabelle dargestellt. Es wurde auf das Erreichen eines ESG-Score des Teilfonds hingearbeitet, der über dem vom Teilfonds ausgewählten Referenzindex liegt.

Alle Emittenten haben eine gute Unternehmensführung bewiesen, was sich am PAI-Score 10 unten ablesen lässt.

### ● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

| Indikator  | Teilfonds | Referenzwert |
|--|-----------|--------------|
| ESG-Score  | 7,66      | 7,26         |
| E-Säule  | 7,68      | 7,63         |
| S-Säule  | 5,50      | 5,16         |
| G-Säule  | 6,05      | 5,79         |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente pro Million Euro Umsatz | 83,41     | 100,61       |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze   | 0,00 %    | 0,43 %       |

der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen

|  |        |        |
|--|--------|--------|
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) | 0,00 % | 0,00 % |
|--|--------|--------|

Die Daten in diesem regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung beziehen sich auf den Stand vom 31. März 2024, basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des am 31. März 2024 endenden Geschäftsjahres.

Referenzwert – iBoxx € Corporates

### **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

| <b>Indikator</b>   | <b>Zeitraum zum</b> | <b>Teilfonds</b> | <b>Referenzwert</b> |
|--|---------------------|------------------|---------------------|
| ESG-Score  | 31. März 2024       | 7,66             | 7,26                |
|  | 31. März 2023       | 8,09             | 7,38                |
| E-Säule  | 31. März 2024       | 7,68             | 7,63                |
|  | 31. März 2023       | 0,00             | 0,00                |
| S-Säule  | 31. März 2024       | 5,50             | 5,16                |
|  | 31. März 2023       | 0,00             | 0,00                |
| G-Säule  | 31. März 2024       | 6,05             | 5,79                |
|  | 31. März 2023       | 0,00             | 0,00                |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO2-Äquivalente pro Million Euro Umsatz  | 31. März 2024       | 83,41            | 100,61              |
|  | 31. März 2023       | 88,00            | 124,07              |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 31. März 2024       | 0,00 %           | 0,43 %              |
|  | 31. März 2023       | 0,00 %           | 0,57 %              |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 31. März 2024       | 0,00 %           | 0,00 %              |
|  | 31. März 2023       | 0,00 %           | 0,00 %              |

Da es sich erst um den zweiten regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung handelt, ist kein Vergleich mit vorangegangenen Zeiträumen möglich.

### **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die vom Teilfonds getätigten nachhaltigen Investitionen trugen unter anderem zu folgenden ökologischen Zielen bei:

1. Reduzierung von Treibhausgasemissionen und Verringerung des CO2-Fußabdrucks;
2. Übergang zu oder die Nutzung von erneuerbarer Energie.

Der Teilfonds bezog die Identifizierung und Analyse der ESG-Referenzen eines Unternehmens als integralen Bestandteil in den Anlageentscheidungsprozess ein, um die Bewertung von Risiken und potenziellen Renditen zu unterstützen. Der Anlageberater zielt darauf ab, durch Berücksichtigung der ESG-Referenzen potenzieller Investitionen einen besseren ESG-Score zu erzielen als der Referenzwert.

### **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Wir bestätigen, dass wir nachhaltige Vermögenswerte darauf geprüft haben, ob sie

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.

erhebliche Beeinträchtigungen verursachen können. Dies erfolgte im Rahmen des Standard-Anlageprozesses von HSBC Asset Management (HSBC) und unter Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen.

*Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?*

Der Anlageberater hat alle durch die Offenlegungsverordnung definierten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI) auf ihre Relevanz für den Teilfonds geprüft. Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren legt fest, wie HSBC die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen identifiziert und darauf reagiert, und in welcher Form HSBC Nachhaltigkeitsrisiken berücksichtigt, die sich negativ auf Wertpapiere auswirken können, in die der Teilfonds investiert. HSBC identifizierte in Zusammenarbeit mit externen Screening-Dienstleistern, wie Sustainalytics, ISS, MSCI und Trucost, Unternehmen und Regierungen mit schlechter Bilanz beim Management von ESG-Risiken, und wo solche wesentlichen Risiken identifiziert wurden, führte HSBC zusätzliche ESG-Due-Diligence-Prüfungen durch. Durch Screening identifizierte Nachhaltigkeitsauswirkungen einschließlich der PAI bildeten einen Schlüsselfaktor beim Anlageentscheidungsprozess.

Der oben beschriebene Ansatz führte dazu, dass unter anderem folgende Faktoren geprüft wurden:

- Engagement der Unternehmen für den Übergang zu CO<sub>2</sub>-armen Wirtschaften, zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern, Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus großen Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails; und
- Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit folgenden Bereichen: demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.

Die spezifischen PAI für diesen Teilfonds waren wie unten beschrieben.

Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren ist auf der Website [www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies](http://www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies) verfügbar.

*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:*

HSBC hat sich der Anwendung und Förderung globaler Standards verpflichtet. Die wichtigsten Schwerpunktbereiche der Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren entsprachen den zehn UNGC-Grundsätzen. Diese Grundsätze stehen in Zusammenhang mit nicht finanziellen Risiken in den Bereichen Menschenrechte, Arbeit, Umweltschutz und Korruptionsbekämpfung. HSBC gehört darüber hinaus zu den Unterzeichnern

der UN Principles for Responsible Investment. Diese bildeten den Rahmen für Ermittlung und Management von Nachhaltigkeitsrisiken beim Investmentansatz von HSBC.

Von Unternehmen, in die der Teilfonds investierte, wurde erwartet, dass sie die Anforderungen des UNGC und der damit verbundenen Standards erfüllen. Unternehmen, die belegbar gegen einen der zehn Grundsätze des UNGC verstießen, wurden systematisch ausgeschlossen. Der Teilfonds führte verstärkte Due-Diligence-Prüfungen bei Unternehmen durch, die als nicht konform mit den Prinzipien des UNGC angesehen wurden oder die nach den unternehmenseigenen ESG Ratings von HSBC als risikoreich angesehen wurden. Darüber hinaus wurden die Unternehmen nach internationalen Standards wie den OECD-Leitsätzen bewertet.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen. Hierbei gelten spezifische von der Union definierte Kriterien.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*



### **Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Der Teilfonds berücksichtigte die folgenden PAI, indem er sie als Nachhaltigkeitsindikatoren beobachtete:

- Treibhausgasintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1 und Scope 2)
- Verstöße gegen die UNGC- und OECD-Grundsätze
- Anteil der Investitionen mit Beteiligung an umstrittenen Waffen

Der Ansatz zur Berücksichtigung der PAI beinhaltete unter anderem, dass HSBC das Engagement der Unternehmen für den Übergang zu CO<sub>2</sub>-armen Wirtschaften, die zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern sowie die Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette prüfte, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails. Ebenfalls berücksichtigt wurde das Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit den Bereichen demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.

Das Screening führte dazu, dass HSBC nicht in bestimmte Unternehmen und Emittenten investierte.



## Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der Investitionen** entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden: basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des Bezugszeitraums zum 31.03.2024

| Größte Investitionen                                     | Sektor                         | % der Vermögenswerte | Land                           |
|--|--------------------------------|----------------------|--------------------------------|
| Autoroutes Du Sud De La France Sa 3,25 % 19.01.2033      | Industriegüter                 | 1,53 %               | Frankreich                     |
| Esb Finance Dac 4,0 % 03.05.2032                         | Finanzen                       | 1,49 %               | Irland                         |
| Nordea Bank Abp 0,625 % 18.08.2031                       | Finanzen                       | 1,45 %               | Finnland                       |
| At&t Inc. 4,3% 18.11.2034                                | Kommunikationsdienstleistungen | 1,37 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Credit Agricole S.a. 3,875 % 20.04.2031                  | Finanzen                       | 1,29 %               | Frankreich                     |
| Credit Agricole S.a. 1,625 % 05.06.2030                  | Finanzen                       | 1,28 %               | Frankreich                     |
| L'oreal S.a. 3,375 % 23.11.2029                          | Basiskonsumgüter               | 1,28 %               | Frankreich                     |
| Skandinaviska Enskilda Banken Ab 5,0 % 17.08.2033        | Finanzen                       | 1,26 %               | Schweden                       |
| Teollisuuden Voima Oyj 4,75 % 01.06.2030                 | Versorger                      | 1,18 %               | Finnland                       |
| Universal Music Group N.v. 4,0 % 13.06.2031              | Kommunikationsdienstleistungen | 1,17 %               | Niederlande                    |
| Dnb Bank Asa 5,0 % 13.09.2033                            | Finanzen                       | 1,16 %               | Norwegen                       |
| Veralto Corporation 4,15 % 19.09.2031                    | Industriegüter                 | 1,16 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Procter & Gamble Company 3,25 % 02.08.2031               | Basiskonsumgüter               | 1,15 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Bnp Paribas Cardif Societe Anonyme 4,032 % Perp          | Finanzen                       | 1,12 %               | Frankreich                     |
| Reseau De Transport D'electricite S.a. 3,75 % 04.07.2035 | Versorger                      | 1,11 %               | Frankreich                     |

Barmittel und Derivate wurden nicht berücksichtigt

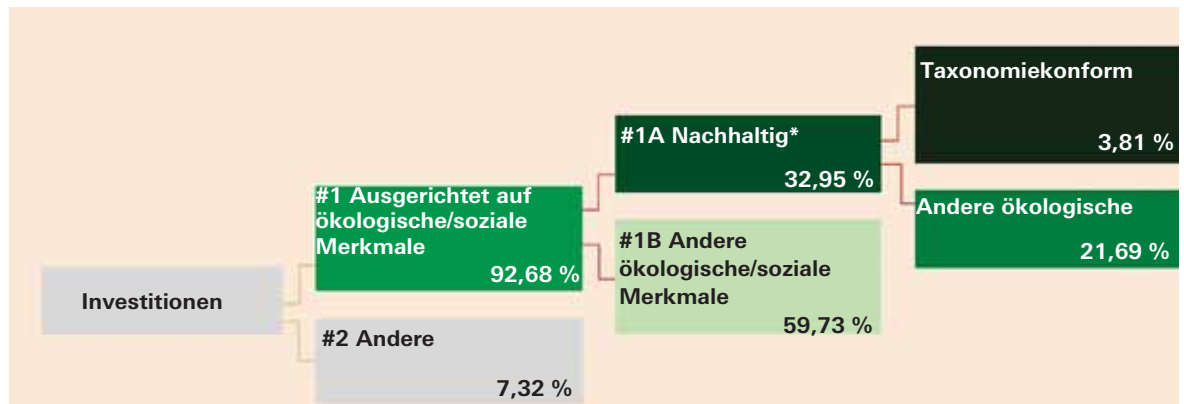


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

32,95 % des Portfolios waren in nachhaltige Vermögenswerte investiert.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?



**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**#2 Andere Investitionen** umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

\* Ein Unternehmen oder Emittent, das bzw. der als nachhaltige Investition angesehen wird, kann sowohl zu einem sozialen als auch zu einem ökologischen Ziel beitragen, das an der EU-Taxonomie ausgerichtet sein kann oder nicht. Die Zahlen in der obigen Grafik berücksichtigen dies. Jedoch darf eine Gesellschaft oder ein Emittent unter dem Punkt der nachhaltigen Investitionen (#1A Nachhaltige Investitionen) nur einmal erfasst werden.

Die Prozentzahlen von taxonomiekonformen Investitionen und Andere ökologische Merkmale stimmen aufgrund der unterschiedlichen Berechnungsmethoden für nachhaltige Investitionen und taxonomiekonforme Investitionen nicht mit #1A Nachhaltige Investitionen überein.

## In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

| Sektor / Teilsektor                    | % der Vermögenswerte |
|--|----------------------|
| Finanzen                               | 33,78 %              |
| Andere                                 | 18,80 %              |
| <i>Erdgas</i>                          | 0,86 %               |
| Industriegüter                         | 10,61 %              |
| Versorger                              | 9,74 %               |
| <i>Stromversorgungsbetriebe</i>        | 6,13 %               |
| <i>Erdgas</i>                          | 0,46 %               |
| <i>Multi-Versorger</i>                 | 2,16 %               |
| Kommunikationsdienstleistungen         | 6,78 %               |
| Staatsanleihen                         | 5,67 %               |
| Basiskonsumgüter                       | 4,72 %               |
| Zyklische Konsumgüter                  | 3,01 %               |
| Barmittel und Derivate                 | 2,66 %               |
| Gesundheitswesen                       | 1,09 %               |
| Energie                                | 0,92 %               |
| <i>Integrierter Öl- und Gaskonzern</i> | 0,92 %               |
| Immobilien                             | 0,86 %               |
| Informationstechnologie                | 0,75 %               |
| Grundstoffe                            | 0,60 %               |
| Summe                                  | 100,00 %             |

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der: **- Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



## Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

Der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen ist in den obigen Feldern zur Vermögensallokation ersichtlich.

### Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen.

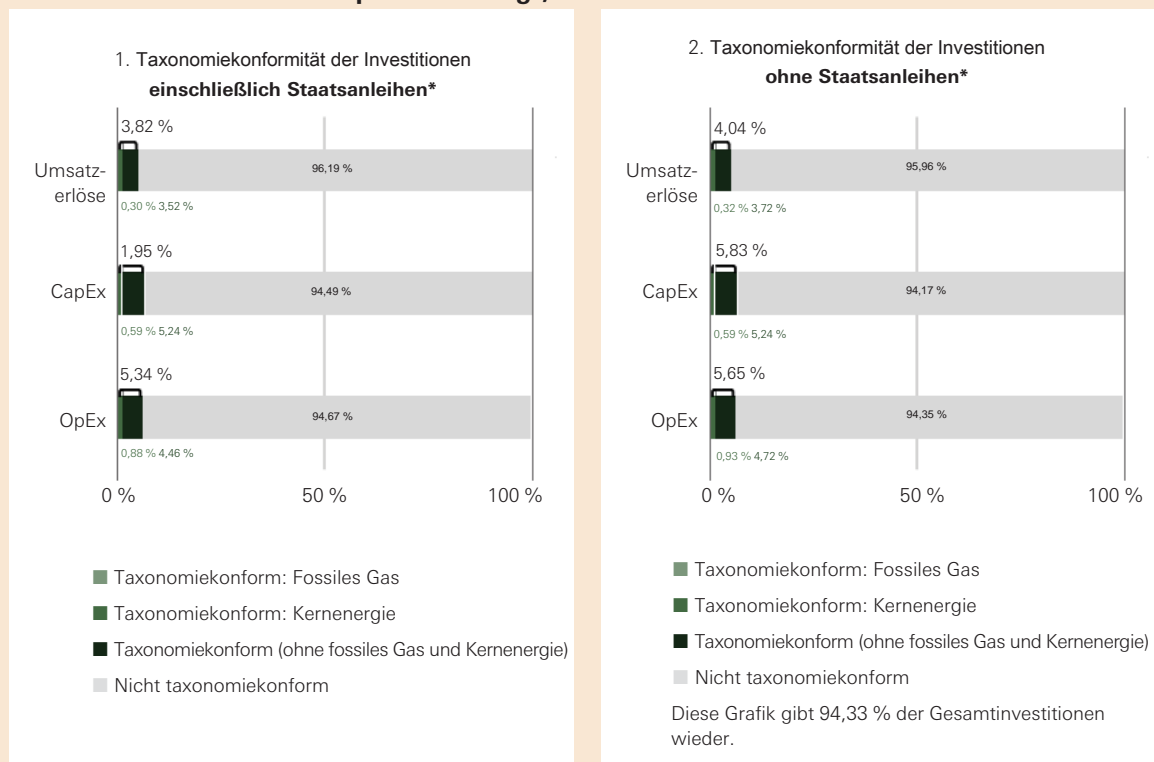
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

### Übergangstätigkeiten

sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



\* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

### Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Im Referenzzeitraum betrug der Anteil der Investitionen des Fonds, die in Übergangstätigkeiten geflossen sind, 0,31 % und der Anteil der Investitionen, die in ermöglichende Tätigkeiten geflossen ist, 2,50 %.

### Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

| Indikator   | 2023-2024 | 2022-2023 |
|---|-----------|-----------|
| Umsatz – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                       | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform: Kernenergie                        | 0,30 %    | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie) | 3,52 %    | 0,00 %    |
| Umsatz – Nicht taxonomiekonform                               | 96,19 %   | 100,00 %  |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                        | 0,00 %    | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                         | 0,56 %    | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)  | 4,96 %    | 0,00 %    |
| CAPEX – Nicht taxonomiekonform                                | 94,49 %   | 100,00 %  |
| OPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                         | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                          | 0,88 %    | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)   | 4,46 %    | 0,00 %    |
| OPEX – Nicht taxonomiekonform                                 | 94,67 %   | 100,00 %  |

Da es sich erst um den zweiten Berichtszeitraum des Teilfonds handelt, ist ein Vergleich mit der Zeit davor nicht erforderlich.





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?**

Der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel war 21,69 %. Der Teilfonds hat sich nicht verpflichtet, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen.



### **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Teilfonds investierte nicht in sozial nachhaltige Anlagen.



### **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

#2 Andere Investitionen umfasst die Finanzinstrumente, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden. In manchen Fällen ist dies auf die Nichtverfügbarkeit von Daten und Unternehmensmaßnahmen zurückzuführen. Diese Positionen unterlagen nach wie vor dem vollständigen Ausschluss-Screening von HSBC und wurden im Hinblick auf verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Prinzipien des UNGC und der OECD geprüft.

Der Teilfonds hielt Barmittel / Barmitteläquivalente (der Prozentsatz der gehaltenen Barmittel ist in der obigen Tabelle der Sektoren/Teilsektoren unter der Überschrift „In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?“ ersichtlich) zum Zwecke des Liquiditätsmanagements sowie derivative Finanzinstrumente zum Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements. Barmittel / Barmitteläquivalente und derivative Finanzinstrumente verfügen aufgrund der Art dieser Instrumente über keinen ökologischen oder sozialen Mindestschutz.



### **Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?**

Im Laufe des Berichtszeitraums schloss der Anlageberater unter anderem verbotene Waffen, umstrittene Waffen, Unternehmen, die mehr als 10 % ihres Umsatzes aus Kraftwerkskohle und Energieerzeugung aus Kohle generieren, und Tabakherstellung aus und investierte in Unternehmen mit verantwortungsvollen Geschäftspraktiken gemäß den Prinzipien des UNGC.

Alle Positionen des Portfolios wurden hinsichtlich ihrer individuellen Treibhausgasintensität bewertet, was zu PAI-Scores führte, die im Einklang mit denen des Referenzwerts lagen. Der Teilfonds bewertete auch ESG-Scores mit dem Ergebnis, dass der ESG-Score während des gesamten Berichtszeitraums über dem des Referenzwerts lag.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Nicht zutreffend.

- **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?**

Nicht zutreffend.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen 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.

Name des Produkts: HSBC GLOBAL INVESTMENT FUNDS - EURO HIGH YIELD BOND

Unternehmenskennung (LEI-Code): T0V7HE6AJ96APO3LYL24

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

| <input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> Ja  | <input type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> Nein   |
|--|---|
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel</b> getätigt: _ %<br><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit <b>ökologische/soziale Merkmale beworben</b> und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 35,97 % an nachhaltigen Investitionen<br><input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel |
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel</b> getätigt: _ %  | <input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine <b>nachhaltigen Investitionen getätigt</b>   |



### Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Während des Geschäftsjahres zum 31. März 2024 (der Bezugszeitraum) bewarb der Teilfonds die folgenden Merkmale:

1. Der Teilfonds prüfte und analysierte alle Unternehmen oder Emittenten im Hinblick auf ökologische Merkmale, insbesondere physische Risiken durch den Klimawandel und Personalmanagement. Für die zugrunde liegenden E-, S- und G-Säulen wurden ein Screening sowie ein Vergleich mit dem für den Teilfonds definierten

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Referenzwert durchgeführt. „E“ und „S“ spiegeln die einzelnen Elemente der vom Teilfonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale wider, „G“ die Unternehmensführungspraktiken, die die Interessen von Minderheitsaktionären schützen und eine langfristige nachhaltige Wertschöpfung fördern.

2. Der Teilfonds berücksichtigte verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Grundsätzen des Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC) und den Leitsätzen für multinationale Unternehmen der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für Unternehmen. Wurden potenzielle Verstöße gegen die Prinzipien des UNGC festgestellt, wurden die Emittenten einer eigenen Due-Diligence-Prüfung hinsichtlich ESG-Themen unterzogen, um festzustellen, ob sie für die Aufnahme in das Portfolio des Teilfonds geeignet sind, und sie auszuschließen, falls sie als ungeeignet erachtet wurden.

3. Der Teilfonds schloss als umweltschädlich eingestufte Geschäftsaktivitäten aus, wie Kraftwerkskohle und Energieerzeugung aus Kohle.

4. Der Teilfonds berücksichtigte aktiv ökologische und soziale Aspekte, indem er über unsere Engagement- und Stewardship-Teams Mitwirkung bei Emittenten umsetzte, wo HSBC Asset Management dies für angemessen hielt.

5. Der Teilfonds schloss nach entsprechender Analyse Anlagen in umstrittenen Waffen aus.

Der ESG-Score stammt vom externen ESG-Datenanbieter MSCI. Die Berücksichtigung einzelner (in der nachstehenden Tabelle nummerierter) wichtigster nachteiliger Auswirkungen (PAI) drückt sich im Vergleich zum Referenzwert aus. Die bei der Berechnung der PAI-Werte verwendeten Daten stammen von externen Datenanbietern. Sie können auf Unternehmensangaben basieren oder von den Datenanbietern geschätzt werden, wo keine solchen Angaben vorliegen. Bitte beachten Sie, dass es nicht immer möglich ist, die Richtigkeit, Aktualität oder Vollständigkeit der von Drittanbietern bereitgestellten Daten zu garantieren.

Der Referenzwert für den Teilfonds wurde zur Beurteilung des ESG-Rating des Teilfonds angewandt. Das ESG-Rating des Teilfonds errechnet sich aus dem Vergleich des gewichteten Durchschnitts der ESG-Ratings der Emittenten des Teilfonds und dem gewichteten Durchschnitt der Bestandteile des Referenzwerts. Der Referenzwert diente jedoch nicht der Erreichung der vom Teilfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale.

Das Abschneiden der Nachhaltigkeitsindikatoren, die der Teilfonds zur Messung der Erreichung der von ihm beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet, ist in der folgenden Tabelle dargestellt. Es wurde auf das Erreichen eines ESG-Score des Teilfonds hingearbeitet, der über dem vom Teilfonds ausgewählten Referenzindex liegt (ein höherer Score als der Referenzwert bedeutet bessere ESG-Referenzen).

Alle Emittenten wiesen Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung vor, die sich durch den unten aufgeführten PAI 10-Score ausdrücken.

### **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

| Indikator  | Teilfonds | Referenzwert |
|--|-----------|--------------|
| ESG-Score  | 7,45      | 6,25         |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente pro Million Euro Umsatz   | 134,43    | 159,88       |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 0,00 %    | 1,55 %       |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen,  | 0,00 %    | 0,00 %       |

Die Daten in diesem regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung beziehen sich auf den Stand vom 31. März 2024, basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des am 31. März 2024 endenden Geschäftsjahres.

Referenzwert - ICE BofA Euro High Yield BB-B Rated Constrained Index

**... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

| Indikator  | Zeitraum zum  | Teilfonds | Referenzwert |
|--|---------------|-----------|--------------|
| ESG-Score  | 31. März 2024 | 7,45      | 6,25         |
|  | 31. März 2023 | 7,17      | 6,00         |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente pro Million Euro Umsatz   | 31. März 2024 | 134,43    | 159,88       |
|  | 31. März 2023 | 103,37    | 228,18       |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 31. März 2024 | 0,00 %    | 1,55 %       |
|  | 31. März 2023 | 0,00 %    | 3,34 %       |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 31. März 2024 | 0,00 %    | 0,00 %       |
|  | 31. März 2023 | 0,00 %    | 0,00 %       |

Da es sich erst um den zweiten regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung handelt, ist kein Vergleich mit vorangegangenen Zeiträumen möglich.

**Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die vom Teilfonds getätigten nachhaltigen Investitionen trugen unter anderem zu folgenden ökologischen Zielen bei:

1. Die Reduzierung von Treibhausgasemissionen und Verringerung des CO<sub>2</sub>-Fußabdrucks;
2. Der Übergang zu oder die Nutzung von erneuerbarer Energie;

Der Teilfonds identifizierte und analysierte ESG-Referenzen eines Unternehmens als wesentlichen Bestandteil des Anlageentscheidungsprozesses zur Reduzierung von Nachhaltigkeitsrisiken und zur Steigerung der Renditen. Der Anlageberater zielt darauf ab, durch Berücksichtigung der ESG-Referenzen potenzieller Investitionen einen besseren ESG-Score zu erzielen als der Referenzwert.

**Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Wir bestätigen, dass wir nachhaltige Vermögenswerte darauf geprüft haben, ob sie erhebliche Beeinträchtigungen verursachen können. Dies erfolgte im Rahmen des Standard-Anlageprozesses von HSBC Asset Management (HSBC) und unter Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen.

*Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?*

Der Anlageberater hat alle durch die Offenlegungsverordnung definierten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI) auf ihre Relevanz für den Teilfonds geprüft. Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren legt fest, wie HSBC die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen identifiziert und

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.

darauf reagiert, und in welcher Form HSBC Nachhaltigkeitsrisiken berücksichtigt, die sich negativ auf Wertpapiere auswirken können, in die der Teilfonds investiert. HSBC identifizierte in Zusammenarbeit mit externen Screening-Dienstleistern, wie Sustainalytics, ISS, MSCI und Trucost, Unternehmen und Regierungen mit schlechter Bilanz beim Management von ESG-Risiken, und wo solche wesentlichen Risiken identifiziert wurden, führte HSBC zusätzliche ESG-Due-Diligence-Prüfungen durch. Durch Screening identifizierte Nachhaltigkeitsauswirkungen einschließlich der PAI bildeten einen Schlüsselfaktor beim Anlageentscheidungsprozess.

Der oben beschriebene Ansatz führte dazu, dass unter anderem folgende Faktoren geprüft wurden:

- Engagement der Unternehmen für den Übergang zu CO<sub>2</sub>-armen Wirtschaften, zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern, Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus großen Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails; und
- Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit folgenden Bereichen: demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.

Die spezifischen PAI für diesen Teilfonds waren wie unten beschrieben.

Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren ist auf der Website [www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies](http://www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies) verfügbar.

*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:*

HSBC hat sich der Anwendung und Förderung globaler Standards verpflichtet. Die wichtigsten Schwerpunktbereiche der Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren entsprachen den zehn UNGC-Grundsätzen. Diese Grundsätze stehen in Zusammenhang mit nicht finanziellen Risiken in den Bereichen Menschenrechte, Arbeit, Umweltschutz und Korruptionsbekämpfung. HSBC gehört darüber hinaus zu den Unterzeichnern der UN Principles for Responsible Investment. Diese bildeten den Rahmen für Ermittlung und Management von Nachhaltigkeitsrisiken beim Investmentansatz von HSBC.

Von Unternehmen, in die der Teilfonds investierte, wurde erwartet, dass sie die Anforderungen des UNGC und der damit verbundenen Standards erfüllen. Unternehmen, die belegbar gegen einen der zehn Grundsätze des UNGC verstießen, wurden systematisch ausgeschlossen. Der Teilfonds führte verstärkte Due-Diligence-Prüfungen bei Unternehmen durch, die als nicht konform mit den Prinzipien des UNGC angesehen wurden oder die nach den unternehmenseigenen ESG Ratings von HSBC als risikoreich angesehen wurden.

Darüber hinaus wurden die Unternehmen nach internationalen Standards wie den OECD-Leitsätzen bewertet.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen. Hierbei gelten spezifische von der Union definierte Kriterien.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*



### **Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Die von diesem Teilfonds berücksichtigten PAI waren:

- Verstöße gegen die UNGC- und OECD-Grundsätze
- Anteil der Investitionen mit Beteiligung an umstrittenen Waffen
- Treibhausgasintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1 und Scope 2)

Der Ansatz zur Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen beinhaltete unter anderem, dass HSBC das Engagement der Unternehmen für den Übergang zu kohlenstoffarmem Wirtschaften, die zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern sowie die Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette prüfte, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails. Ebenfalls berücksichtigt wurde das Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit den Bereichen demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.

Das Screening führte dazu, dass HSBC nicht in bestimmte Unternehmen und Emittenten investierte.



## Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der Investitionen** entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden: basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des Bezugszeitraums zum 31.03.2024

| Größte Investitionen                                    | Sektor                         | % der Vermögenswerte | Land  |
|---|--------------------------------|----------------------|---|
| Tennet Holding B.v. 5,533 % Perp                        | Versorger                      | 3,15 %               | Niederlande   |
| Veolia Environnement SA 2,5 % Perp                      | Versorger                      | 3,09 %               | Frankreich  |
| Ec Finance Plc 3,0 % 15.10.2026                         | Industriegüter                 | 2,13 %               | Vereinigtes Königreich von Großbritannien und Nordirland. |
| Kbc Group Nv 4,25 % Perp                                | Finanzen                       | 2,07 %               | Belgien   |
| Orange Sa 5,0 % Perp                                    | Kommunikationsdienstleistungen | 2,07 %               | Frankreich  |
| Rci Banque Sa 2,625 % 18.02.2030                        | Finanzen                       | 2,02 %               | Frankreich  |
| La Poste Societe Anonyme 3,125 % Perp                   | Industriegüter                 | 2,01 %               | Frankreich  |
| La Banque Postale Societe Anonyme 3,875 % Perp          | Finanzen                       | 1,72 %               | Frankreich  |
| Vodafone Group Plc 2,625 % 27.08.2080                   | Kommunikationsdienstleistungen | 1,68 %               | Vereinigtes Königreich von Großbritannien und Nordirland. |
| Credit Suisse Group Ag 7,75 % 01.03.2029                | Finanzen                       | 1,67 %               | Schweiz   |
| Lkq European Holdings Bv 4,125 % 01.04.2028             | Zyklische Konsumgüter          | 1,59 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH 6,0 % 30.07.2026 | Industriegüter                 | 1,55 %               | Deutschland   |
| Arkema S.a. 2,75 % Perp                                 | Grundstoffe                    | 1,52 %               | Frankreich  |
| Commerzbank Ag 4,25% Perp                               | Finanzen                       | 1,43 %               | Deutschland   |
| Axa Sa 3,941 % Perp                                     | Finanzen                       | 1,39 %               | Frankreich  |

Barmittel und Derivate wurden nicht berücksichtigt



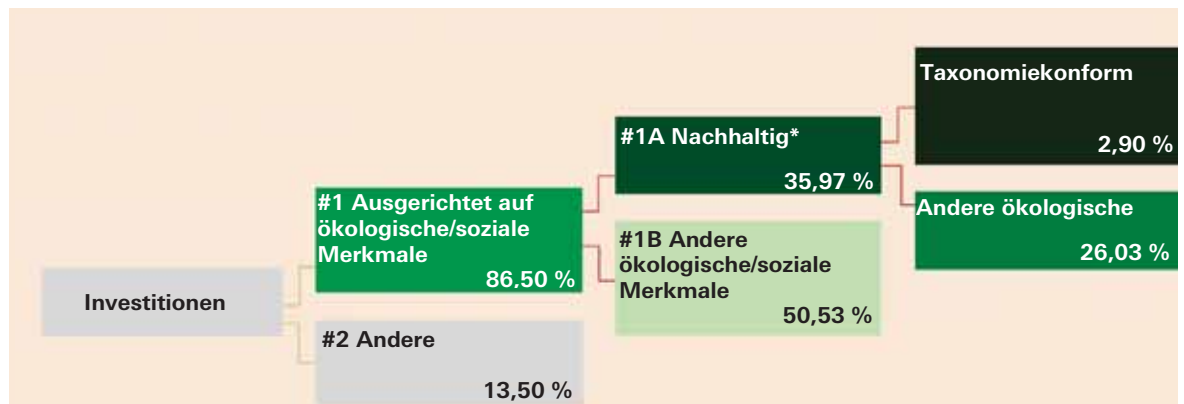


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

35,97 % des Portfolios waren in nachhaltige Vermögenswerte investiert.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?



**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**#2 Andere Investitionen** umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

\* Ein Unternehmen oder Emittent, das bzw. der als nachhaltige Investition angesehen wird, kann sowohl zu einem sozialen als auch zu einem ökologischen Ziel beitragen, das an der EU-Taxonomie ausgerichtet sein kann oder nicht. Die Zahlen in der obigen Grafik berücksichtigen dies. Jedoch darf eine Gesellschaft oder ein Emittent unter dem Punkt der nachhaltigen Investitionen (#1A Nachhaltige Investitionen) nur einmal erfasst werden.

Die Prozentzahlen von taxonomiekonformen Investitionen und Andere ökologische Merkmale stimmen aufgrund der unterschiedlichen Berechnungsmethoden für nachhaltige Investitionen und taxonomiekonforme Investitionen nicht mit #1A Nachhaltige Investitionen überein.

### In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

| Sektor / Teilsektor            | % der Vermögenswerte |
|--------------------------------|----------------------|
| Andere                         | 27,36 %              |
| Finanzen                       | 25,73 %              |
| Kommunikationsdienstleistungen | 11,47 %              |
| Versorger                      | 7,81 %               |
| Stromversorgungsbetriebe       | 4,06 %               |
| Multi-Versorger                | 3,75 %               |
| Industriegüter                 | 7,39 %               |
| Grundstoffe                    | 6,09 %               |
| Zyklische Konsumgüter          | 5,59 %               |
| Immobilien                     | 3,49 %               |
| Gesundheitswesen               | 2,16 %               |
| Staatsanleihen                 | 1,05 %               |
| Basiskonsumgüter               | 0,49 %               |
| Barmittel und Derivate         | 0,34 %               |
| Informationstechnologie        | 0,19 %               |
| Summe                          | 100,00 %             |



## Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Kraftstoffe bis Ende 2035.

Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen.

- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen ist in den obigen Feldern zur Vermögensallokation ersichtlich.

### Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

Ja:



In fossiles Gas

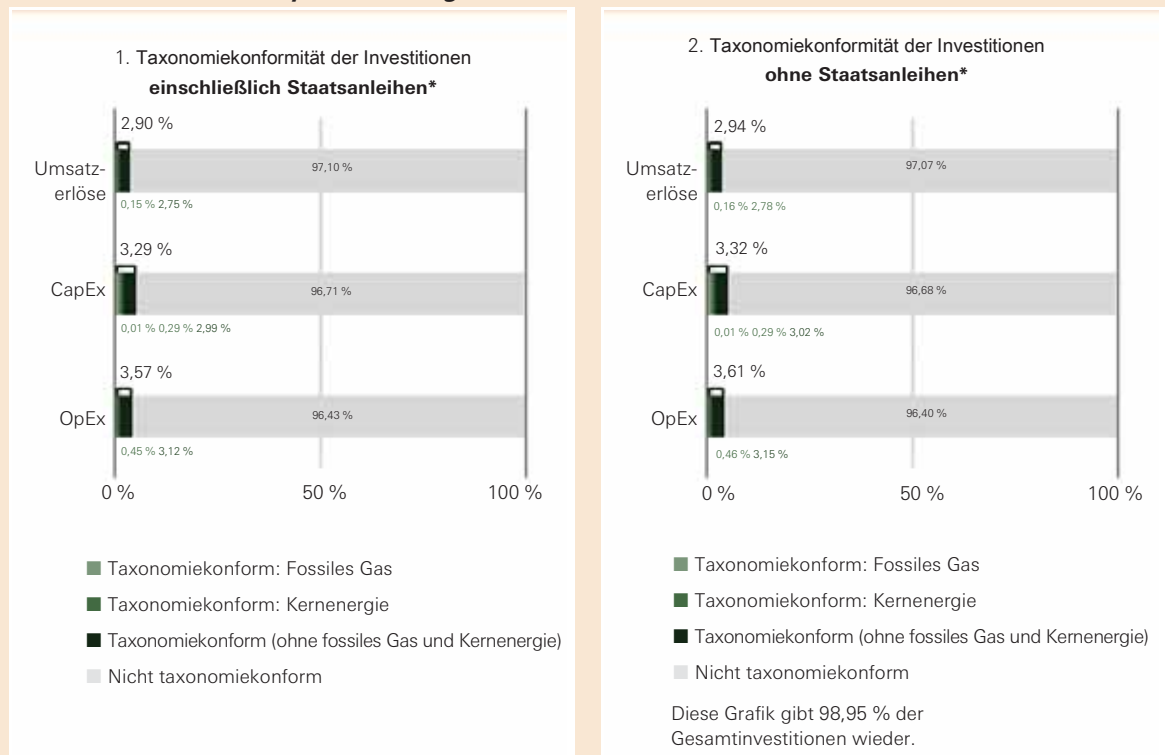


In Kernenergie

Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

**Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.**




\* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

### Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Im Referenzzeitraum betrug der Anteil der Investitionen des Fonds, die in

**Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.

Übergangstätigkeiten geflossen sind, 0,22 % und der Anteil der Investitionen, die in ermöglichende Tätigkeiten geflossen ist, 0,64 %.

**Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

| Indikator   | 2023-2024 | 2022-2023 |
|---|-----------|-----------|
| Umsatz – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                       | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform: Kernenergie                        | 0,15 %    | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie) | 2,75 %    | 0,00 %    |
| Umsatz – Nicht taxonomiekonform                               | 97,10 %   | 100,00 %  |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                        | 0,01 %    | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                         | 0,29 %    | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)  | 2,99 %    | 0,00 %    |
| CAPEX – Nicht taxonomiekonform                                | 96,71 %   | 100,00 %  |
| OPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                         | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                          | 0,45 %    | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)   | 3,12 %    | 0,00 %    |
| OPEX – Nicht taxonomiekonform                                 | 96,43 %   | 100,00 %  |

Da es sich erst um den zweiten Berichtszeitraum des Teilfonds handelt, ist ein Vergleich mit der Zeit davor nicht erforderlich.

 **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel war 26,03 %. Der Teilfonds hat sich nicht verpflichtet, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen.

 **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Teilfonds investierte nicht in sozial nachhaltige Anlagen.

 **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

#2 Andere Investitionen umfasst die Finanzinstrumente, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden. In manchen Fällen ist dies auf die Nichtverfügbarkeit von Daten und Unternehmensmaßnahmen zurückzuführen. Diese Positionen unterlagen nach wie vor dem vollständigen Ausschluss-Screening von HSBC und wurden im Hinblick auf verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Prinzipien des UNGC und der OECD geprüft.

Der Teilfonds hielt Barmittel / Barmitteläquivalente (der Prozentsatz der gehaltenen Barmittel ist in der obigen Tabelle der Sektoren/Teilsektoren unter der Überschrift „In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?“ ersichtlich) zum Zwecke des Liquiditätsmanagements sowie derivative Finanzinstrumente zum Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements. Barmittel / Barmitteläquivalente und derivative Finanzinstrumente verfügen aufgrund der Art dieser Instrumente über keinen ökologischen oder sozialen Mindestschutz.



## Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Im Laufe des Berichtszeitraums schloss der Anlageberater unter anderem verbotene Waffen, umstrittene Waffen, Unternehmen, die mehr als 10 % ihres Umsatzes aus Kraftwerkskohle und Energieerzeugung aus Kohle generieren, und Tabakherstellung aus und investierte in Unternehmen mit verantwortungsvollen Geschäftspraktiken gemäß den Prinzipien des UNGC.

Alle Positionen des Portfolios wurden hinsichtlich ihrer individuellen Treibhausgasintensität bewertet, was zu PAI-Scores führte, die im Einklang mit denen des Referenzwerts lagen. Der Teilfonds bewertete auch ESG-Scores mit dem Ergebnis, dass der ESG-Score während des gesamten Berichtszeitraums über dem des Referenzwerts lag.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend.

● **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Nicht zutreffend.

● **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?**

Nicht zutreffend.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen 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.

Name des Produkts: HSBC Global Investment Funds - ESG Short Duration Credit Bond

Unternehmenskennung (LEI-Code): 21380015NZ84K2X6J127

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

| ●● <input type="checkbox"/> Ja  | ●○ <input checked="" type="checkbox"/> Nein   |
|---|---|
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel</b> getätigt: _ % <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> </ul> | <input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 21,17 % an nachhaltigen Investitionen <ul style="list-style-type: none"> <li><input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel</li> </ul> |
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel</b> getätigt: _ %   | <input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine <b>nachhaltigen Investitionen getätigt</b>   |



### Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Während des am 31. März 2024 endenden Geschäftsjahres (der Bezugszeitraum) hat der Teilfonds Folgendes beworben:

- Es wurde auf das Erreichen eines ESG-Score des Teilfonds hingearbeitet, der über dem vom Teilfonds ausgewählten Referenzindex liegt (ein höherer Score als der Referenzwert bedeutet bessere ESG-Referenzen). Für die zugrunde liegenden E-, S- und G-Säulen wurden ein Screening sowie ein Vergleich mit dem für den Teilfonds definierten Referenzwert durchgeführt. „E“ und „S“ spiegeln die einzelnen Elemente der vom

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Teilfonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale wider, „G“ die Unternehmensführungspraktiken, die die Interessen von Minderheitsaktionären schützen und eine langfristige nachhaltige Wertschöpfung fördern.

2. Der Teilfonds berücksichtigte verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Grundsätzen des Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC) und den Leitsätzen für multinationale Unternehmen der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für Unternehmen. Wurden potenzielle Verstöße gegen die Prinzipien des UNGC festgestellt, wurden die Emittenten einer eigenen Due-Diligence-Prüfung hinsichtlich ESG-Themen unterzogen, um festzustellen, ob sie für die Aufnahme in das Portfolio des Teilfonds geeignet sind, und sie auszuschließen, falls sie als ungeeignet erachtet wurden.

3. Der Teilfonds schloss als umweltschädlich eingestufte Geschäftsaktivitäten aus, wie Kraftwerkskohle und Energieerzeugung aus Kohle.

4. Der Teilfonds berücksichtigte aktiv ökologische und soziale Aspekte, indem er über unsere Engagement- und Stewardship-Teams Mitwirkung bei Emittenten umsetzte, wo HSBC Asset Management dies für angemessen hielt.

5. Der Teilfonds schloss nach entsprechender Analyse Anlagen in umstrittenen Waffen aus.

Der ESG-Score stammt vom externen ESG-Datenanbieter MSCI. Die Berücksichtigung einzelner (in der nachstehenden Tabelle nummerierter) wichtigster nachteiliger Auswirkungen (PAI) drückt sich darin aus, dass der Teilfonds niedrigere Werte als der Referenzwert aufweist. Die bei der Berechnung der PAI-Werte verwendeten Daten stammen von externen Datenanbietern. Sie können auf Unternehmensangaben basieren oder von den Datenanbietern geschätzt werden, wo keine solchen Angaben vorliegen. Bitte beachten Sie, dass es nicht immer möglich ist, die Richtigkeit, Aktualität oder Vollständigkeit der von Drittanbietern bereitgestellten Daten zu garantieren.

Der Teilfonds wurde aktiv verwaltet und bildete keinen Referenzwert nach. Der Referenzwert dient zum Vergleich des Teilfonds mit dem allgemeinen Markt, nicht jedoch der Erreichung der vom Teilfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale. Das Abschneiden der Nachhaltigkeitsindikatoren, die der Teilfonds zur Messung der Erreichung der von ihm beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet, ist in der folgenden Tabelle dargestellt.

Alle Emittenten haben eine gute Unternehmensführung bewiesen, was sich am PAI-Score 10 unten ablesen lässt.

### **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

| Indikator  | Teilfonds | Referenzwert |
|--|-----------|--------------|
| ESG-Score  | 7,13      | 6,08         |
| E-Säule  | 7,14      | 6,25         |
| S-Säule  | 5,22      | 4,75         |
| G-Säule  | 6,19      | 5,89         |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente pro Million Euro Umsatz   | 223,04    | 334,38       |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 0,01 %    | 1,01 %       |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 0,00 %    | 0,03 %       |

Die Daten in diesem regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung beziehen sich auf den Stand vom 31. März 2024, basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des am 31. März 2024 endenden Geschäftsjahres.

Referenzwert - 50 % ICE BofA 1-5 Year BB US High Yield Index und |50 % ICE BofA 1-5 Year BBB US Corporate Index

### **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

| <b>Indikator</b>   | <b>Zeitraum zum</b> | <b>Teilfonds</b> | <b>Referenzwert</b> |
|--|---------------------|------------------|---------------------|
| ESG-Score  | 31. März 2024       | 7,13             | 6,08                |
|  | 31. März 2023       | 7,00             | 5,84                |
| E-Säule  | 31. März 2024       | 7,14             | 6,25                |
|  | 31. März 2023       | 7,43             | 6,23                |
| S-Säule  | 31. März 2024       | 5,22             | 4,75                |
|  | 31. März 2023       | 4,90             | 4,61                |
| G-Säule  | 31. März 2024       | 6,19             | 5,89                |
|  | 31. März 2023       | 6,08             | 5,78                |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente pro Million Euro Umsatz   | 31. März 2024       | 223,04           | 334,38              |
|  | 31. März 2023       | 147,11           | 358,28              |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 31. März 2024       | 0,01 %           | 1,01 %              |
|  | 31. März 2023       | 0,00 %           | 1,30 %              |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 31. März 2024       | 0,00 %           | 0,03 %              |
|  | 31. März 2023       | 0,00 %           | 0,00 %              |

Da es sich erst um den zweiten regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung handelt, ist kein Vergleich mit vorangegangenen Zeiträumen möglich.

### **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die vom Teilfonds getätigten nachhaltigen Investitionen trugen unter anderem zu folgenden ökologischen Zielen bei:

1. Reduzierung von Treibhausgasemissionen und Verringerung des CO<sub>2</sub>-Fußabdrucks;
2. Übergang zu oder die Nutzung von erneuerbarer Energie.

Der Teilfonds identifizierte und analysierte ESG-Referenzen eines Unternehmens als wesentlichen Bestandteil des Anlageentscheidungsprozesses für die Portfoliokonstruktion mit dem Ziel, Nachhaltigkeitsrisiken zu reduzieren und Renditen zu steigern. Der Anlageberater zielt darauf ab, durch Berücksichtigung der ESG-Referenzen potenzieller Investitionen einen besseren ESG-Score zu erzielen als der Referenzwert.

### **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Wir bestätigen, dass wir nachhaltige Vermögenswerte darauf geprüft haben, ob sie erhebliche Beeinträchtigungen verursachen können. Dies erfolgte im Rahmen des Standard-Anlageprozesses von HSBC Asset Management (HSBC) und unter Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen.

*Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?*

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 Anlageberater hat alle durch die Offenlegungsverordnung definierten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI) auf ihre Relevanz für den Teilfonds geprüft. Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren legt fest, wie HSBC die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen identifiziert und darauf reagiert, und in welcher Form HSBC Nachhaltigkeitsrisiken berücksichtigt, die sich negativ auf Wertpapiere auswirken können, in die der Teilfonds investiert. HSBC identifizierte in Zusammenarbeit mit externen Screening-Dienstleistern, wie Sustainalytics, ISS, MSCI und Trucost, Unternehmen und Regierungen mit schlechter Bilanz beim Management von ESG-Risiken, und wo solche wesentlichen Risiken identifiziert wurden, führte HSBC zusätzliche ESG-Due-Diligence-Prüfungen durch. Durch Screening identifizierte Nachhaltigkeitsauswirkungen einschließlich der PAI bildeten einen Schlüsselfaktor beim Anlageentscheidungsprozess.

Der oben beschriebene Ansatz führte dazu, dass unter anderem folgende Faktoren geprüft wurden:

- Engagement der Unternehmen für den Übergang zu CO2-armen Wirtschaften, zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern, Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus großen Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails; und
- Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit folgenden Bereichen: demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.

Die spezifischen PAI für diesen Teilfonds waren wie unten beschrieben.

Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren ist auf der Website [www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies](http://www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies) verfügbar.

*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:*

HSBC hat sich der Anwendung und Förderung globaler Standards verpflichtet. Die wichtigsten Schwerpunktbereiche der Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren entsprachen den zehn UNGC-Grundsätzen. Diese Grundsätze stehen in Zusammenhang mit nicht finanziellen Risiken in den Bereichen Menschenrechte, Arbeit, Umweltschutz und Korruptionsbekämpfung. HSBC gehört darüber hinaus zu den Unterzeichnern der UN Principles for Responsible Investment. Diese bildeten den Rahmen für Ermittlung und Management von Nachhaltigkeitsrisiken beim Investmentansatz von HSBC.

Von Unternehmen, in die der Teilfonds investierte, wurde erwartet, dass sie die Anforderungen des UNGC und der damit verbundenen Standards erfüllen.



Unternehmen, die belegbar gegen einen der zehn Grundsätze des UNGC verstießen, wurden systematisch ausgeschlossen. Der Teilfonds führte verstärkte Due-Diligence-Prüfungen bei Unternehmen durch, die als nicht konform mit den Prinzipien des UNGC angesehen wurden oder die nach den unternehmenseigenen ESG Ratings von HSBC als risikoreich angesehen wurden. Darüber hinaus wurden die Unternehmen nach internationalen Standards wie den OECD-Leitsätzen bewertet.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen. Hierbei gelten spezifische von der Union definierte Kriterien.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*



### **Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Weitere vom Teilfonds berücksichtigte wichtigste nachteilige Auswirkungen sind:

- Treibhausgasintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1 und Scope 2)
- Verstöße gegen die UNGC- und OECD-Grundsätze
- Anteil der Investitionen mit Beteiligung an umstrittenen Waffen

Der Ansatz zur Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen beinhaltete unter anderem, dass HSBC das Engagement der Unternehmen für den Übergang zu kohlenstoffarmem Wirtschaften, die zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern sowie die Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette prüfte, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails. Ebenfalls berücksichtigt wurde das Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit den Bereichen demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.

Das Screening führte dazu, dass HSBC nicht in bestimmte Unternehmen und Emittenten investierte.



## Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der Investitionen** entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden: basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des Bezugszeitraums zum 31.03.2024

| Größte Investitionen  | Sektor                         | % der Vermögenswerte | Land  |
|---|--------------------------------|----------------------|---|
| Bpce Societe Anonyme 2,045 %<br>19.10.2027                              | Finanzen                       | 3,12 %               | Frankreich  |
| Societe Generale Sa 4,75 %<br>24.11.2025                                | Finanzen                       | 2,71 %               | Frankreich  |
| Barclays PLC 2,852 % 07.05.2026   | Finanzen                       | 2,66 %               | Vereinigtes Königreich von Großbritannien und Nordirland. |
| Graphic Packaging International, Llc<br>1,512 % 15.04.2026              | Grundstoffe                    | 2,26 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| Cco Holdings, Llc 5,125 %<br>01.05.2027                                 | Kommunikationsdienstleistungen | 2,22 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| Aercap Ireland Capital Dac 6,1 %<br>15.01.2027                          | Finanzen                       | 2,12 %               | Irland  |
| Wrkco Inc. 4,0 % 15.03.2028   | Grundstoffe                    | 1,97 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| Tdf Infrastructure Societe Par Actions Simplifiee 5,625 %<br>21.07.2028 | Kommunikationsdienstleistungen | 1,58 %               | Frankreich  |
| Amgen Inc. 5,507 % 02.03.2026   | Gesundheitswesen               | 1,52 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| Crown European Holdings Sa<br>3,375 % 15.05.2025                        | Grundstoffe                    | 1,48 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| Baxter International Inc. 1,3 %<br>30.05.2025                           | Gesundheitswesen               | 1,45 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| American Tower Corporation<br>1,95 % 22.05.2026                         | Immobilien                     | 1,44 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| Trivium Packaging Finance BV<br>3,75 % 15.08.2026                       | Grundstoffe                    | 1,44 %               | Niederlande   |
| Iqvia Inc. 1,75 % 15.03.2026  | Gesundheitswesen               | 1,42 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| Mondelez International, Inc.<br>1,625 % 08.03.2027                      | Basiskonsumgüter               | 1,42 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |

Barmittel und Derivate wurden nicht berücksichtigt

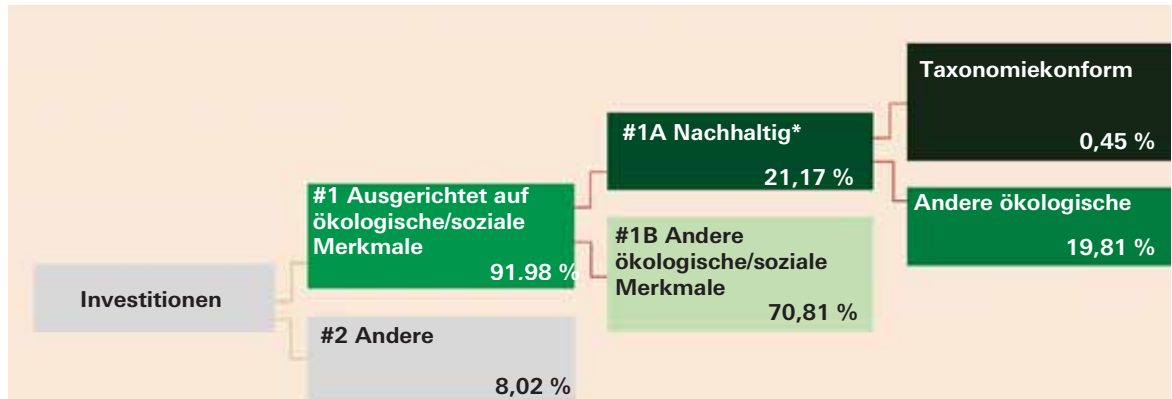


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

21,17 % des Portfolios waren in nachhaltige Vermögenswerte investiert.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?



**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**#2 Andere Investitionen** umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

\* Ein Unternehmen oder Emittent, das bzw. der als nachhaltige Investition angesehen wird, kann sowohl zu einem sozialen als auch zu einem ökologischen Ziel beitragen, das an der EU-Taxonomie ausgerichtet sein kann oder nicht. Die Zahlen in der obigen Grafik berücksichtigen dies. Jedoch darf eine Gesellschaft oder ein Emittent unter dem Punkt der nachhaltigen Investitionen (#1A Nachhaltige Investitionen) nur einmal erfasst werden.

Die Prozentzahlen von taxonomiekonformen Investitionen und Andere ökologische Merkmale stimmen aufgrund der unterschiedlichen Berechnungsmethoden für nachhaltige Investitionen und taxonomiekonforme Investitionen nicht mit #1A Nachhaltige Investitionen überein.

## In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

| Sektor / Teilsektor                              | % der Vermögenswerte |
|--|----------------------|
| Andere   | 30,92 %              |
| <i>Exploration und Produktion von Öl und Gas</i> | 0,81 %               |
| <i>Raffination und Vertrieb von Öl und Gas</i>   | 0,95 %               |
| <i>Lagerung und Transport von Öl und Gas</i>     | 3,14 %               |
| Finanzen   | 15,29 %              |
| Grundstoffe                                      | 14,35 %              |
| Gesundheitswesen                                 | 6,49 %               |
| Zyklische Konsumgüter                            | 5,76 %               |
| Industriegüter                                   | 4,79 %               |
| Energie  | 4,69 %               |
| <i>Integrierter Öl- und Gaskonzern</i>           | 0,53 %               |
| <i>Exploration und Produktion von Öl und Gas</i> | 0,78 %               |
| <i>Lagerung und Transport von Öl und Gas</i>     | 3,37 %               |
| Immobilien                                       | 4,46 %               |
| Kommunikationsdienstleistungen                   | 4,14 %               |
| Versorger  | 2,87 %               |
| <i>Stromversorgungsbetriebe</i>                  | 1,50 %               |
| <i>Multi-Versorger</i>                           | 1,36 %               |
| Informationstechnologie                          | 2,70 %               |
| Basiskonsumgüter                                 | 1,80 %               |
| Staatsanleihen                                   | 1,36 %               |
| Barmittel und Derivate                           | 0,38 %               |
| Summe  | 100,00 %             |

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für Kernenergie beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:



## Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

Der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen ist in den obigen Feldern zur Vermögensallokation ersichtlich.

### Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen.

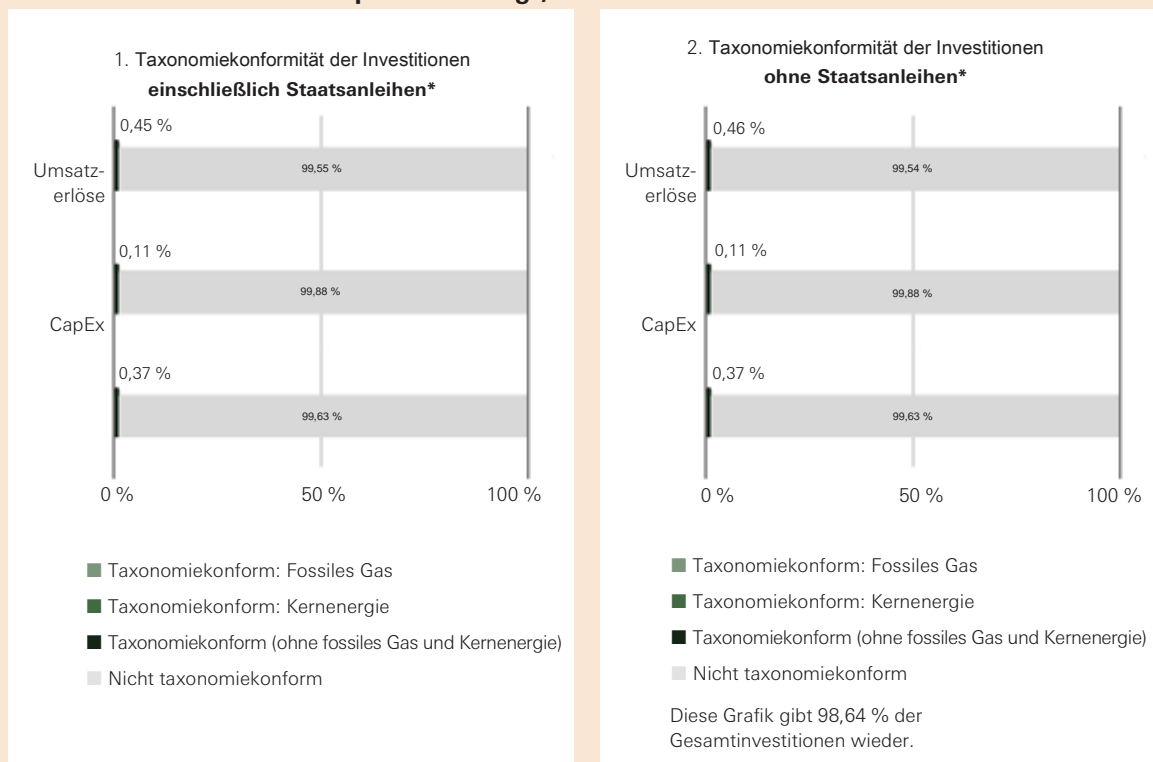
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

### Übergangstätigkeiten

sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



\* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

### Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Im Referenzzeitraum betrug der Anteil der Investitionen des Fonds, die in Übergangstätigkeiten geflossen sind, 0,00 % und der Anteil der Investitionen, die in ermöglichende Tätigkeiten geflossen ist, 0,03 %.

### Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

| Indikator   | 2023-2024 | 2022-2023 |
|---|-----------|-----------|
| Umsatz – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                       | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform: Kernenergie                        | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie) | 0,45 %    | 0,00 %    |
| Umsatz – Nicht taxonomiekonform                               | 99,55 %   | 100,00 %  |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                        | 0,00 %    | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                         | n. z.     | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)  | 0,11 %    | 0,00 %    |
| CAPEX – Nicht taxonomiekonform                                | 99,88 %   | 100,00 %  |
| OPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                         | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                          | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)   | 0,37 %    | 0,00 %    |
| OPEX – Nicht taxonomiekonform                                 | 99,63 %   | 100,00 %  |

Da es sich erst um den zweiten Berichtszeitraum des Teilfonds handelt, ist ein Vergleich mit der Zeit davor nicht erforderlich.



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?**

Der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel war 19,81 %. Der Teilfonds hat sich nicht verpflichtet, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen.



### **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Teilfonds investierte nicht in sozial nachhaltige Anlagen.



### **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

#2 Andere Investitionen umfasst die Finanzinstrumente, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden. In manchen Fällen ist dies auf die Nichtverfügbarkeit von Daten und Unternehmensmaßnahmen zurückzuführen. Diese Positionen unterlagen nach wie vor dem vollständigen Ausschluss-Screening von HSBC und wurden im Hinblick auf verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Prinzipien des UNGC und der OECD geprüft.

Der Teilfonds hielt Barmittel / Barmitteläquivalente (der Prozentsatz der gehaltenen Barmittel ist in der obigen Tabelle der Sektoren/Teilsektoren unter der Überschrift „In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?“ ersichtlich) zum Zwecke des Liquiditätsmanagements sowie derivative Finanzinstrumente zum Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements. Barmittel / Barmitteläquivalente und derivative Finanzinstrumente verfügen aufgrund der Art dieser Instrumente über keinen ökologischen oder sozialen Mindestschutz.



### **Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?**

Der Anlageberater begann mit einer monatlichen Bewertung, um mindestens 20 % des Anlageuniversums auszusondern. Dies umfasste das Aussondern ausgeschlossener Aktivitäten, einschließlich, aber nicht beschränkt auf verbotene Waffen, umstrittene Waffen, Unternehmen, die mehr als 10 % ihres Umsatzes aus Kraftwerkskohle und Energieerzeugung aus Kohle generieren, und Tabakherstellung aus und investierte in Unternehmen mit verantwortungsvollen Geschäftspraktiken gemäß den Prinzipien des UNGC. Zudem wurden auch Emittenten berücksichtigt, deren bereinigte MSCI ESG-Scores unter einem vordefinierten Schwellenwert lagen, sowie E-, S- und G-Scores, die über den von der Gesellschaft festgelegten Mindestschwellenwerten lagen. Insgesamt wurden mindestens 20 % des Anlageuniversums ausgeschlossen, und der Teilfonds hat in keinen dieser Emittenten investiert. Darüber hinaus mussten auch alle anderen neuen Emittenten, die derzeit nicht zum Anlageuniversum gehören, die oben genannten Bedingungen einhalten.

Anschließend wurde ein Portfolio erstellt. Alle Positionen des Portfolios wurden hinsichtlich ihrer individuellen Treibhausgasintensität bewertet, was zu PAI-Scores führte, die im Einklang mit denen des Referenzwerts lagen. Der Teilfonds bewertete auch ESG-Scores mit dem Ergebnis, dass der ESG-Score während des gesamten Berichtszeitraums über dem des Referenzwerts lag.

Darüber hinaus wurden alle Positionen auf Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der OECD untersucht, um Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung innerhalb des Portfolios sicherzustellen.

Das Portfolio musste auch signifikante Verbesserungsziele für ESG-Scores, Kohlenstoffemissionen und fossile Brennstoffreserven einhalten, die über denen des Anlageuniversums lagen.



### **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

● ***Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?***

Nicht zutreffend.

● ***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?***

Nicht zutreffend.

● ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?***

Nicht zutreffend.

● ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?***

Nicht zutreffend.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Name des Produkts: HSBC GLOBAL INVESTMENT FUNDS - GLOBAL BOND

Unternehmenskennung (LEI-Code): 2138003JMNNOHPVAFG48

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

| <input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> <b>Ja</b>   | <input type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> <b>Nein</b>   |
|--|--|
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel</b> getätigt: _ %<br><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit <b>ökologische/soziale Merkmale beworben</b> und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 6,81 % an nachhaltigen Investitionen<br><input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel |
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel</b> getätigt: _ %  | <input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>ökologische/soziale Merkmale beworben</b> , aber keine <b>nachhaltigen Investitionen getätigt</b>  |



### Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Während des Geschäftsjahres zum 31. März 2024 (der Bezugszeitraum) bewarb der Teilfonds die folgenden Merkmale:

1. Der Teilfonds prüfte und analysierte alle Unternehmen oder Emittenten im Hinblick auf ökologische Merkmale, insbesondere physische Risiken durch den Klimawandel und Personalmanagement. Für die zugrunde liegenden E-, S- und G-Säulen wurden ein Screening sowie ein Vergleich mit dem für den Teilfonds definierten Referenzwert durchgeführt. „E“ und „S“ spiegeln die einzelnen Elemente der vom



Teilfonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale wider, „G“ die Unternehmensführungspraktiken, die die Interessen von Minderheitsaktionären schützen und eine langfristige nachhaltige Wertschöpfung fördern.

2. Der Teilfonds berücksichtigte verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Grundsätzen des Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC) und den Leitsätzen für multinationale Unternehmen der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für Unternehmen. Wurden potenzielle Verstöße gegen die Prinzipien des UNGC festgestellt, wurden die Emittenten einer eigenen Due-Diligence-Prüfung hinsichtlich ESG-Themen unterzogen, um festzustellen, ob sie für die Aufnahme in das Portfolio des Teilfonds geeignet sind, und sie auszuschließen, falls sie als ungeeignet erachtet wurden.
3. Der Teilfonds schloss als umweltschädlich eingestufte Geschäftsaktivitäten aus, wie Kraftwerkskohle und Energieerzeugung aus Kohle.
4. Der Teilfonds berücksichtigte aktiv ökologische und soziale Aspekte, indem er über unsere Engagement- und Stewardship-Teams Mitwirkung bei Emittenten umsetzte, wo HSBC Asset Management dies für angemessen hielt.
5. Der Teilfonds schloss nach entsprechender Analyse Anlagen in umstrittenen Waffen aus.

Der ESG-Score stammt vom externen ESG-Datenanbieter MSCI. Die Berücksichtigung einzelner (in der nachstehenden Tabelle nummerierter) wichtigster nachteiliger Auswirkungen (PAI) drückt sich im Vergleich zum Referenzwert aus. Die bei der Berechnung der PAI-Werte verwendeten Daten stammen von externen Datenanbietern. Sie können auf Unternehmensangaben basieren oder von den Datenanbietern geschätzt werden, wo keine solchen Angaben vorliegen. Bitte beachten Sie, dass es nicht immer möglich ist, die Richtigkeit, Aktualität oder Vollständigkeit der von Drittanbietern bereitgestellten Daten zu garantieren.

Der Referenzwert für den Teilfonds wurde zur Beurteilung des ESG-Rating des Teilfonds angewandt. Das ESG-Rating des Teilfonds errechnet sich aus dem Vergleich des gewichteten Durchschnitts der ESG-Ratings der Emittenten des Teilfonds und dem gewichteten Durchschnitt der Bestandteile des Referenzwerts. Der Referenzwert diente jedoch nicht der Erreichung der vom Teilfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale.

Das Abschneiden der Nachhaltigkeitsindikatoren, die der Teilfonds zur Messung der Erreichung der von ihm beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet, ist in der folgenden Tabelle dargestellt. Es wurde auf das Erreichen eines ESG-Score des Teilfonds hingearbeitet, der über dem vom Teilfonds ausgewählten Referenzindex liegt (ein höherer Score als der Referenzwert bedeutet bessere ESG-Referenzen).

Alle Emittenten haben eine gute Unternehmensführung bewiesen, was sich am PAI-Score 10 unten ablesen lässt.

### **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

| <b>Indikator</b>   | <b>Teilfonds</b> | <b>Referenzwert</b> |
|--|------------------|---------------------|
| ESG-Score  | 6,22             | 5,95                |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente pro Million Euro Umsatz   | 160,26           | 171,20              |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 0,35 %           | 0,12 %              |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 0,00 %           | 0,01 %              |

|  |        |        |
|--|--------|--------|
| 15. THG-Emissionsintensität - Kennzahl in Kilotonnen pro BIP-Einheit (in Millionen Euro) | 355,93 | 349,49 |
|--|--------|--------|

Die Daten in diesem regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung beziehen sich auf den Stand vom 31. März 2024, basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des am 31. März 2024 endenden Geschäftsjahres.

Referenzwert - Bloomberg Global Aggregate

### **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

| Indikator  | Zeitraum zum  | Teilfonds | Referenzwert |
|--|---------------|-----------|--------------|
| ESG-Score  | 31. März 2024 | 6,22      | 5,95         |
|  | 31. März 2023 | 6,20      | 6,00         |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente pro Million Euro Umsatz   | 31. März 2024 | 160,26    | 171,20       |
|  | 31. März 2023 | 190,21    | 194,75       |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 31. März 2024 | 0,35 %    | 0,12 %       |
|  | 31. März 2023 | 0,45 %    | 0,54 %       |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 31. März 2024 | 0,00 %    | 0,01 %       |
|  | 31. März 2023 | 0,00 %    | 0,00 %       |
| 15. THG-Emissionsintensität - Kennzahl in Kilotonnen pro BIP-Einheit (in Millionen Euro)   | 31. März 2024 | 355,93    | 349,49       |
|  | 31. März 2023 | 267,70    | 257,11       |

Da es sich erst um den zweiten regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung handelt, ist kein Vergleich mit vorangegangenen Zeiträumen möglich.

### **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die vom Teilfonds getätigten nachhaltigen Investitionen trugen unter anderem zu folgenden ökologischen Zielen bei:

1. Reduzierung von Treibhausgasemissionen und Verringerung des CO<sub>2</sub>-Fußabdrucks;
2. Übergang zu oder die Nutzung von erneuerbarer Energie.

Der Teilfonds strebt über die Portfoliokonstruktion einen im Vergleich zu den Bestandteilen des Referenzwerts besseren ESG-Gesamtwert des Portfolios an.

### **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Wir bestätigen, dass wir nachhaltige Vermögenswerte darauf geprüft haben, ob sie erhebliche Beeinträchtigungen verursachen können. Dies erfolgte im Rahmen des Standard-Anlageprozesses von HSBC Asset Management (HSBC) und unter Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen.

#### *Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?*

Der Anlageberater hat alle durch die Offenlegungsverordnung definierten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI) auf ihre Relevanz für den Teilfonds geprüft. Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren legt fest, wie HSBC die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen identifiziert und

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.

darauf reagiert, und in welcher Form HSBC Nachhaltigkeitsrisiken berücksichtigt, die sich negativ auf Wertpapiere auswirken können, in die der Teilfonds investiert. HSBC identifizierte in Zusammenarbeit mit externen Screening-Dienstleistern, wie Sustainalytics, ISS, MSCI und Trucost, Unternehmen und Regierungen mit schlechter Bilanz beim Management von ESG-Risiken, und wo solche wesentlichen Risiken identifiziert wurden, führte HSBC zusätzliche ESG-Due-Diligence-Prüfungen durch. Durch Screening identifizierte Nachhaltigkeitsauswirkungen einschließlich der PAI bildeten einen Schlüsselfaktor beim Anlageentscheidungsprozess.

Der oben beschriebene Ansatz führte dazu, dass unter anderem folgende Faktoren geprüft wurden:

- Engagement der Unternehmen für den Übergang zu CO<sub>2</sub>-armen Wirtschaften, zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern, Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus großen Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails; und
- Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit folgenden Bereichen: demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.

Die spezifischen PAI für diesen Teilfonds waren wie unten beschrieben.

Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren ist auf der Website [www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies](http://www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies) verfügbar.

*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:*

HSBC hat sich der Anwendung und Förderung globaler Standards verpflichtet. Die wichtigsten Schwerpunktbereiche der Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren entsprachen den zehn UNGC-Grundsätzen. Diese Grundsätze stehen in Zusammenhang mit nicht finanziellen Risiken in den Bereichen Menschenrechte, Arbeit, Umweltschutz und Korruptionsbekämpfung. HSBC gehört darüber hinaus zu den Unterzeichnern der UN Principles for Responsible Investment. Diese bildeten den Rahmen für Ermittlung und Management von Nachhaltigkeitsrisiken beim Investmentansatz von HSBC.

Von Unternehmen, in die der Teilfonds investierte, wurde erwartet, dass sie die Anforderungen des UNGC und der damit verbundenen Standards erfüllen. Unternehmen, die belegbar gegen einen der zehn Grundsätze des UNGC verstießen, wurden systematisch ausgeschlossen. Der Teilfonds führte verstärkte Due-Diligence-Prüfungen bei Unternehmen durch, die als nicht konform mit den Prinzipien des UNGC angesehen wurden oder die nach den unternehmenseigenen ESG Ratings von HSBC als risikoreich angesehen wurden.

Darüber hinaus wurden die Unternehmen nach internationalen Standards wie den OECD-Leitsätzen bewertet.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen. Hierbei gelten spezifische von der Union definierte Kriterien.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*



### **Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Die von diesem Teilfonds berücksichtigten PAI waren:

- Treibhausgasintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1 und Scope 2)
- Verstöße gegen die UNGC- und OECD-Grundsätze
- Anteil der Investitionen mit Beteiligung an umstrittenen Waffen
- Treibhausgasintensität von staatlichen Emittenten

Der Ansatz zur Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen beinhaltete unter anderem, dass HSBC das Engagement der Unternehmen für den Übergang zu kohlenstoffarmem Wirtschaften, die zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern sowie die Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette prüfte, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails. Ebenfalls berücksichtigt wurde das Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit den Bereichen demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.

Das Screening führte dazu, dass HSBC nicht in bestimmte Unternehmen und Emittenten investierte.



## Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der Investitionen** entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden: basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des Bezugszeitraums zum 31.03.2024

| Größte Investitionen   | Sektor         | % der Vermögenswerte | Land                           |
|--|----------------|----------------------|--------------------------------|
| HSBC Global Investment Funds SICAV – Global Asset-Backed Crossover Bond – ZQ1 – Distribution | Andere         | 4,78 %               | Luxemburg                      |
| Government Of China 3,27 % 19.11.2030  | Staatsanleihen | 3,37 %               | China                          |
| Government Of New Zealand 3,5 % 14.04.2033   | Staatsanleihen | 2,51 %               | Neuseeland                     |
| Government Of The United States Of America 4,125 % 31.07.2028                                | Staatsanleihen | 2,48 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Government Of The United States Of America 1,375 % 15.08.2050                                | Staatsanleihen | 1,94 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Government Of China 1,99 % 09.04.2025  | Staatsanleihen | 1,79 %               | China                          |
| Government Of The United States Of America 4,375 % 30.11.2028                                | Staatsanleihen | 1,74 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Government Of The United States Of America 4,0 % 31.01.2029                                  | Staatsanleihen | 1,63 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Government Of The United States Of America 4,0 % 15.02.2034                                  | Staatsanleihen | 1,61 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Government Of The United States Of America 1,375 % 15.11.2040                                | Staatsanleihen | 1,57 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Government Of The United States Of America 4,0 % 31.01.2031                                  | Staatsanleihen | 1,57 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Government Of Italy 0,35 % 01.02.2025  | Staatsanleihen | 1,46 %               | Italien                        |
| Government Of The United States Of America 1,625 % 15.05.2026                                | Staatsanleihen | 1,45 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| European Investment Bank 2,15 % 18.01.2027   | Staatsanleihen | 1,41 %               | SUPRANATIONAL                  |
| Government Of Germany 0,25 % 15.02.2027  | Staatsanleihen | 1,34 %               | Deutschland                    |

Barmittel und Derivate wurden nicht berücksichtigt

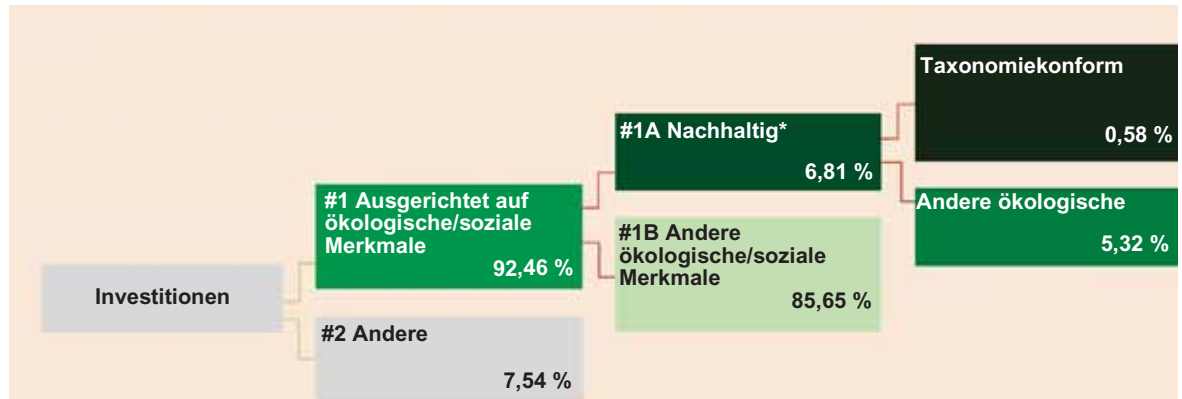


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

6,81 % des Portfolios waren in nachhaltige Vermögenswerte investiert.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?



**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**#2 Andere Investitionen** umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

\* Ein Unternehmen oder Emittent, das bzw. der als nachhaltige Investition angesehen wird, kann sowohl zu einem sozialen als auch zu einem ökologischen Ziel beitragen, das an der EU-Taxonomie ausgerichtet sein kann oder nicht. Die Zahlen in der obigen Grafik berücksichtigen dies. Jedoch darf eine Gesellschaft oder ein Emittent unter dem Punkt der nachhaltigen Investitionen (#1A Nachhaltige Investitionen) nur einmal erfasst werden.

Die Prozentzahlen von taxonomiekonformen Investitionen und Andere ökologische Merkmale stimmen aufgrund der unterschiedlichen Berechnungsmethoden für nachhaltige Investitionen und taxonomiekonforme Investitionen nicht mit #1A Nachhaltige Investitionen überein.

## In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

| Sektor / Teilsektor                          | % der Vermögenswerte |
|--|----------------------|
| Staatsanleihen                               | 67,39 %              |
| Andere                                       | 23,88 %              |
| <i>Erdgas</i>                                | <i>0,14 %</i>        |
| <i>Lagerung und Transport von Öl und Gas</i> | <i>0,05 %</i>        |
| Finanzen                                     | 8,38 %               |
| Versorger                                    | 3,08 %               |
| <i>Stromversorgungsbetriebe</i>              | <i>1,55 %</i>        |
| <i>Erdgas</i>                                | <i>0,26 %</i>        |
| <i>Multi-Versorger</i>                       | <i>1,15 %</i>        |
| Industriegüter                               | 2,19 %               |
| Kommunikationsdienstleistungen               | 1,76 %               |
| Immobilien                                   | 0,91 %               |
| Zyklische Konsumgüter                        | 0,78 %               |
| Grundstoffe                                  | 0,57 %               |
| Gesundheitswesen                             | 0,34 %               |
| Energie                                      | 0,33 %               |
| <i>Integrierter Öl- und Gaskonzern</i>       | <i>0,21 %</i>        |
| <i>Lagerung und Transport von Öl und Gas</i> | <i>0,11 %</i>        |
| Informationstechnologie                      | 0,22 %               |
| Basiskonsumgüter                             | 0,07 %               |
| Barmittel und Derivate                       | -9,90 %              |
| Summe  | 100,00 %             |



## Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

Der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen ist in den obigen Feldern zur Vermögensallokation ersichtlich.

### Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonmiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonmiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonmiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Mit Blick auf die EU-Taxonmiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Taxonmiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

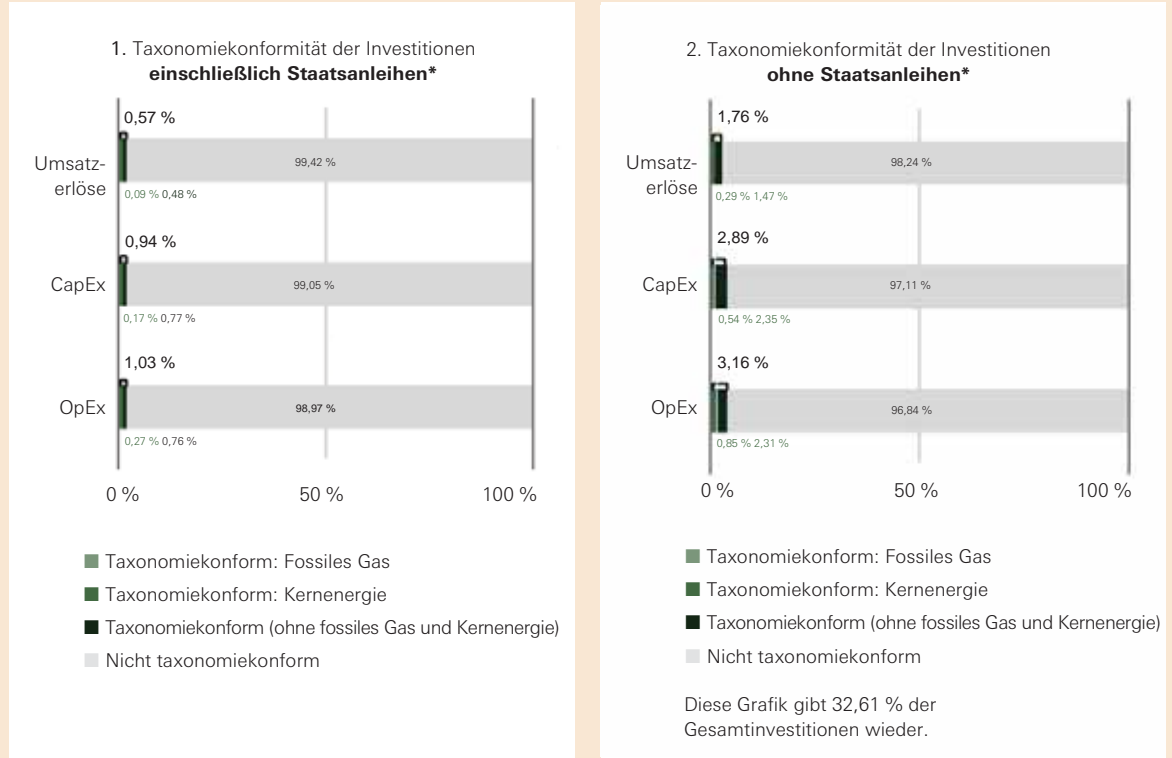
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen.

- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

**Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

**Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-Taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.**



\* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Im Referenzzeitraum betrug der Anteil der Investitionen des Fonds, die in Übergangstätigkeiten geflossen sind, 0,09 % und der Anteil der Investitionen, die in ermöglichende Tätigkeiten geflossen ist, 0,22 %.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

| Indikator   | 2023-2024 | 2022-2023 |
|---|-----------|-----------|
| Umsatz – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                       | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform: Kernenergie                        | 0,09 %    | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie) | 0,48 %    | 0,00 %    |
| Umsatz – Nicht taxonomiekonform                               | 99,42 %   | 100,00 %  |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                        | 0,00 %    | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                         | 0,17 %    | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)  | 0,77 %    | 0,00 %    |
| CAPEX – Nicht taxonomiekonform                                | 99,05 %   | 100,00 %  |
| OPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                         | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                          | 0,27 %    | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)   | 0,76 %    | 0,00 %    |
| OPEX – Nicht taxonomiekonform                                 | 98,97 %   | 100,00 %  |

Da es sich erst um den zweiten Berichtszeitraum des Teilfonds handelt, ist ein Vergleich mit der Zeit davor nicht erforderlich.





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?**

Der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel war 5,32 %. Der Teilfonds hat sich nicht verpflichtet, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen.



### **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Teilfonds investierte nicht in sozial nachhaltige Anlagen.



### **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

#2 Andere Investitionen umfasst die Finanzinstrumente, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden. In manchen Fällen ist dies auf die Nichtverfügbarkeit von Daten und Unternehmensmaßnahmen zurückzuführen. Diese Positionen unterlagen nach wie vor dem vollständigen Ausschluss-Screening von HSBC und wurden im Hinblick auf verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Prinzipien des UNGC und der OECD geprüft.

Der Teilfonds hielt Barmittel / Barmitteläquivalente (der Prozentsatz der gehaltenen Barmittel ist in der obigen Tabelle der Sektoren/Teilektoren unter der Überschrift „In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?“ ersichtlich) zum Zwecke des Liquiditätsmanagements sowie derivative Finanzinstrumente zum Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements. Barmittel / Barmitteläquivalente und derivative Finanzinstrumente verfügen aufgrund der Art dieser Instrumente über keinen ökologischen oder sozialen Mindestschutz.



### **Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?**

Im Laufe des Berichtszeitraums schloss der Anlageberater unter anderem verbotene Waffen, umstrittene Waffen, Unternehmen, die mehr als 10 % ihres Umsatzes aus Kraftwerkskohle und Energieerzeugung aus Kohle generieren, und Tabakherstellung aus und investierte in Unternehmen mit verantwortungsvollen Geschäftspraktiken gemäß den Prinzipien des UNGC.

Alle Positionen des Portfolios wurden hinsichtlich ihrer individuellen Treibhausgasintensität bewertet, was zu PAI-Scores führte, die im Einklang mit denen des Referenzwerts lagen. Der Teilfonds bewertete auch ESG-Scores mit dem Ergebnis, dass der ESG-Score während des gesamten Berichtszeitraums über dem des Referenzwerts lag.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Nicht zutreffend.

- **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?**

Nicht zutreffend.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Name des Produkts: HSBC GLOBAL INVESTMENT FUNDS - GLOBAL BOND TOTAL RETURN

Unternehmenskennung (LEI-Code): 213800AEAJM0Q76VRI57

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

- Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: \_ %
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
  - in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: \_ %

Nein

- Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 35,57 % an nachhaltigen Investitionen
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
  - mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
  - mit einem sozialen Ziel
- Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine **nachhaltigen Investitionen getätigt**

### Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Während des am 31. März 2024 endenden Geschäftsjahres (der Bezugszeitraum) hat der Teilfonds Folgendes beworben:

- Der Teilfonds prüfte und analysierte alle Unternehmen oder Emittenten im Hinblick auf ökologische Merkmale, insbesondere physische Risiken durch den Klimawandel und Personalmanagement. Für die zugrunde liegenden E-, S- und G-Säulen wurden ein Screening sowie ein Vergleich mit dem für den Teilfonds definierten Referenzwert durchgeführt. „E“ und „S“ spiegeln die einzelnen Elemente der vom Teilfonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale wider, „G“ die Unternehmensführungspraktiken, die die Interessen von Minderheitsaktionären schützen und eine langfristige nachhaltige Wertschöpfung fördern.



2. Der Teilfonds berücksichtigte verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Grundsätzen des Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC) und den Leitsätzen für multinationale Unternehmen der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für Unternehmen. Wurden potenzielle Verstöße gegen die Prinzipien des UNGC festgestellt, wurden die Emittenten einer eigenen Due-Diligence-Prüfung hinsichtlich ESG-Themen unterzogen, um festzustellen, ob sie für die Aufnahme in das Portfolio des Teilfonds geeignet sind, und sie auszuschließen, falls sie als ungeeignet erachtet wurden.
3. Der Teilfonds schloss als umweltschädlich eingestufte Geschäftsaktivitäten aus, wie Kraftwerkskohle und Energieerzeugung
4. Der Teilfonds berücksichtigte aktiv ökologische und soziale Aspekte, indem er über unsere Engagement- und Stewardship-Teams Mitwirkung bei Emittenten umsetzte,
5. und wo HSBC Asset Management dies für angemessen erachtete, analysierte der Teilfonds Investitionen in umstrittene Waffen und schloss diese aus.

Die ESG-Scores stammen vom externen ESG-Datenanbieter MSCI. Die Berücksichtigung einzelner (in der nachstehenden Tabelle nummerierter) wichtigster nachteiliger Auswirkungen (PAI) drückt sich darin aus, dass der Teilfonds niedrigere Werte als der Referenzwert aufweist. Die bei der Berechnung der PAI-Werte verwendeten Daten stammen von externen Datenanbietern. Sie können auf Unternehmensangaben basieren oder von den Datenanbietern geschätzt werden wo keine solchen Angaben vorliegen. Bitte beachten Sie, dass es nicht immer möglich ist, die Richtigkeit, Aktualität oder Vollständigkeit der von Drittanbietern bereitgestellten Daten zu garantieren.

Der Teilfonds wurde ohne Bezugnahme auf Marktindexgewichtungen verwaltet. Hierzu strebte der Teilfonds ein höheres ESG-Rating (berechnet als gewichteter Durchschnitt der ESG-Ratings der Emittenten der Anlagen des Teilfonds) im Vergleich zum gewichteten Durchschnitt der ESG-Ratings der Bestandteile der einzelnen Anlageklassen des Teilfonds an. Der Teilfonds wurde aktiv verwaltet. Es war kein Referenzwert für den Teilfonds festgelegt.

Das Abschneiden der Nachhaltigkeitsindikatoren, die der Teilfonds zur Messung der Erreichung der von ihm beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet, ist in der folgenden Tabelle dargestellt. Alle Emittenten haben eine gute Unternehmensführung bewiesen, was sich am PAI-Score 10 unten ablesen lässt.

### ● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

| Indikator  | Teilfonds |
|--|-----------|
| ESG-Score  | 6,87      |
| E-Säule  | 7,15      |
| S-Säule  | 5,31      |
| G-Säule  | 5,93      |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente pro Million Euro Umsatz   | 159,15    |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 0,07 %    |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 0,00 %    |
| 15. THG-Emissionsintensität - Kennzahl in Kilotonnen pro BIP-Einheit (in Millionen Euro)   | 401,74    |

Die Daten in diesem regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung beziehen sich auf den Stand vom 31. März 2024, basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des am 31. März 2024 endenden Geschäftsjahres.

### **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

| <b>Indikator</b>   | <b>Zeitraum zum</b> | <b>Teilfonds</b> |
|--|---------------------|------------------|
| ESG-Score  | 31. März 2024       | 6,87             |
|  | 31. März 2023       | 6,84             |
| E-Säule  | 31. März 2024       | 7,15             |
|  | 31. März 2023       | 0,00             |
| S-Säule  | 31. März 2024       | 5,31             |
|  | 31. März 2023       | 0,00             |
| G-Säule  | 31. März 2024       | 5,93             |
|  | 31. März 2023       | 0,00             |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird –<br>Tonnen CO2-Äquivalente pro Million Euro Umsatz   | 31. März 2024       | 159,15           |
|  | 31. März 2023       | 168,41           |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der<br>Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung<br>(OECD) für multinationale Unternehmen | 31. März 2024       | 0,07 %           |
|  | 31. März 2023       | 0,00 %           |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen,<br>Streumunition, chemische und biologische Waffen)  | 31. März 2024       | 0,00 %           |
|  | 31. März 2023       | 0,00 %           |
| 15. THG-Emissionsintensität - Kennzahl in Kilotonnen pro BIP-Einheit<br>(in Millionen Euro)  | 31. März 2024       | 401,74           |
|  | 31. März 2023       | 272,72           |

Da es sich erst um den zweiten regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung handelt, ist kein Vergleich mit vorangegangenen Zeiträumen möglich.

### **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die vom Teilfonds getätigten nachhaltigen Investitionen trugen unter anderem zu folgenden ökologischen Zielen bei:

1. Reduzierung von Treibhausgasemissionen und Verringerung des CO<sub>2</sub>-Fußabdrucks;
2. Übergang zu oder die Nutzung von erneuerbarer Energie.

Der Fonds bezog die Identifizierung und Analyse der ESG-Referenzen eines Emittenten als integralen Bestandteil in den Anlageentscheidungsprozess ein, um die Bewertung von Risiken und potenziellen Renditen zu unterstützen.

### **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Wir bestätigen, dass wir nachhaltige Vermögenswerte darauf geprüft haben, ob sie erhebliche Beeinträchtigungen verursachen können. Dies erfolgte im Rahmen des Standard-Anlageprozesses von HSBC Asset Management (HSBC) und unter Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen.

*Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?*

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 Anlageberater hat alle durch die Offenlegungsverordnung definierten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI) auf ihre Relevanz für den Teilfonds geprüft. Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren legt fest, wie HSBC die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen identifiziert und darauf reagiert, und in welcher Form HSBC Nachhaltigkeitsrisiken berücksichtigt, die sich negativ auf Wertpapiere auswirken können, in die der Teilfonds investiert. HSBC identifizierte in Zusammenarbeit mit externen Screening-Dienstleistern, wie Sustainalytics, ISS, MSCI und Trucost, Unternehmen und Regierungen mit schlechter Bilanz beim Management von ESG-Risiken, und wo solche wesentlichen Risiken identifiziert wurden, führte HSBC zusätzliche ESG-Due-Diligence-Prüfungen durch. Durch Screening identifizierte Nachhaltigkeitsauswirkungen einschließlich der PAI bildeten einen Schlüsselfaktor beim Anlageentscheidungsprozess.

Der oben beschriebene Ansatz führte dazu, dass unter anderem folgende Faktoren geprüft wurden:

- Engagement der Unternehmen für den Übergang zu CO<sub>2</sub>-armen Wirtschaften, zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern, Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus großen Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails; und
- Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit folgenden Bereichen: demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.

Die spezifischen PAI für diesen Teilfonds waren wie unten beschrieben.

Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren ist auf der Website <http://www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies> verfügbar.

*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:*

HSBC hat sich der Anwendung und Förderung globaler Standards verpflichtet. Die wichtigsten Schwerpunktbereiche der Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren entsprachen den zehn UNGC-Grundsätzen. Diese Grundsätze stehen in Zusammenhang mit nicht finanziellen Risiken in den Bereichen Menschenrechte, Arbeit, Umweltschutz und Korruptionsbekämpfung. HSBC gehört darüber hinaus zu den Unterzeichnern der UN Principles for Responsible Investment. Diese bildeten den Rahmen für Ermittlung und Management von Nachhaltigkeitsrisiken beim Investmentansatz von HSBC.

Von Unternehmen, in die der Teilfonds investierte, wurde erwartet, dass sie die Anforderungen des UNGC und der damit verbundenen Standards erfüllen. Unternehmen, die belegbar gegen einen der zehn Grundsätze des UNGC

verstießen, wurden systematisch ausgeschlossen. Der Teilfonds führte verstärkte Due-Diligence-Prüfungen bei Unternehmen durch, die als nicht konform mit den Prinzipien des UNGC angesehen wurden oder die nach den unternehmenseigenen ESG Ratings von HSBC als risikoreich angesehen wurden. Darüber hinaus wurden die Unternehmen nach internationalen Standards wie den OECD-Leitsätzen bewertet.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen. Hierbei gelten spezifische von der Union definierte Kriterien.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*



### **Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Die vom Teilfonds berücksichtigte wichtigste nachteilige Auswirkungen waren:

- Treibhausgasintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1 und Scope 2)
- Verstöße gegen die Prinzipien des UNGC und die OECD-Leitsätze
- Anteil der Investitionen mit Beteiligung an umstrittenen Waffen
- Treibhausgasintensität von staatlichen Emittenten

Der Ansatz zur Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen beinhaltete unter anderem, dass HSBC das Engagement der Unternehmen für den Übergang zu kohlenstoffarmem Wirtschaften, die zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern sowie die Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette prüfte, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails. Ebenfalls berücksichtigt wurde das Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit den Bereichen demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.

Das Screening führte dazu, dass HSBC nicht in bestimmte Unternehmen und Emittenten investierte.



## Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** Investitionen entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden: basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des Bezugszeitraums zum 31.03.2024

| Größte Investitionen   | Sektor         | % der Vermögen | Land  |
|--|----------------|----------------|---|
| Government Of The United States Of America 4,25 % 28.02.2029                   | Staatsanleihen | 2,80 %         | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| Government Of New Zealand 3,5 % 14.04.2033                                     | Staatsanleihen | 2,65 %         | Neuseeland  |
| Government Of Germany 2,1 % 12.04.2029   | Staatsanleihen | 1,92 %         | Deutschland   |
| Natwest Group Pic 3,622 % 14.08.2030   | Finanzen       | 1,58 %         | Vereinigtes Königreich von Großbritannien und Nordirland. |
| Hdfc Bank Ltd 5,18 % 15.02.2029  | Finanzen       | 1,42 %         | Indien  |
| Government Of Mexico 7,75 % 13.11.2042   | Staatsanleihen | 1,16 %         | Mexiko  |
| Mexico Remittances Funding Fiduciary Estate Management Sarl 4,875 % 15.01.2028 | Finanzen       | 1,14 %         | Mexiko  |
| E.on Se 3,5 % 25.03.2032   | Versorger      | 1,10 %         | Deutschland   |
| Government Of Poland 5,125 % 18.09.2034  | Staatsanleihen | 1,04 %         | Polen   |
| Bank Of America Na 5,526 % 18.08.2026  | Finanzen       | 1,01 %         | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| Banque Stellantis France Sa 4.0 % 21.01.2027                                   | Finanzen       | 0,94 %         | Frankreich  |
| Aircastle Limited 6,5 % 18.07.2028   | Industriegüter | 0,93 %         | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| Ca Auto Bank S.p.a. Irish Branch 6,0 % 06.12.2026                              | Finanzen       | 0,93 %         | Italien   |
| Jackson National Life Global Fund ing 5,25 % 12.04.2028                        | Finanzen       | 0,91 %         | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| Aircastle Limited 5,25 % 11.08.2025  | Industriegüter | 0,90 %         | Vereinigte Staaten von Amerika                            |

Barmittel und Derivate wurden nicht berücksichtigt



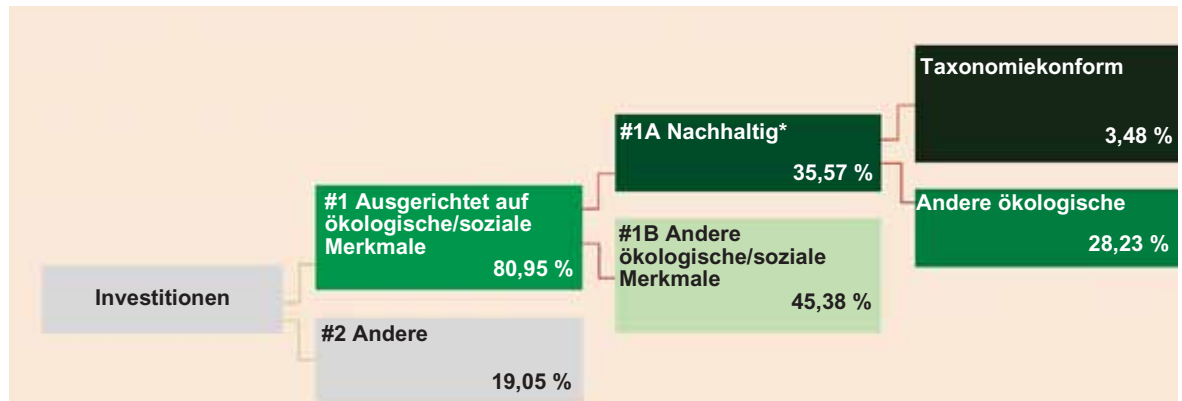


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

35,57 % des Portfolios waren in nachhaltige Vermögenswerte investiert.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

### ● *Wie sah die Vermögensallokation aus?*



**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**#2 Andere Investitionen** umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

\* Ein Unternehmen oder Emittent, das bzw. der als nachhaltige Investition angesehen wird, kann sowohl zu einem sozialen als auch zu einem ökologischen Ziel beitragen, das an der EU-Taxonomie ausgerichtet sein kann oder nicht. Die Zahlen in der obigen Grafik berücksichtigen dies. Jedoch darf eine Gesellschaft oder ein Emittent unter dem Punkt der nachhaltigen Investitionen (#1A Nachhaltige Investitionen) nur einmal erfasst werden.

Die Prozentzahlen von taxonomiekonformen Investitionen und Andere ökologische Merkmale stimmen aufgrund der unterschiedlichen Berechnungsmethoden für nachhaltige Investitionen und taxonomiekonforme Investitionen nicht mit #1A Nachhaltige Investitionen überein.

## In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

| Sektor / Teilsektor                                   | % der Vermögenswerte |
|---|----------------------|
| Andere  | 34,94 %              |
| <i>Ausrüstung und Dienstleistungen für Öl und Gas</i> | <i>0,41 %</i>        |
| <i>Lagerung und Transport von Öl und Gas</i>          | <i>0,12 %</i>        |
| Finanzen  | 27,90 %              |
| Staatsanleihen  | 7,87 %               |
| Versorger   | 6,91 %               |
| <i>Stromversorgungsbetriebe</i>                       | <i>2,73 %</i>        |
| <i>Erdgas</i>   | <i>0,55 %</i>        |
| <i>Multi-Versorger</i>                                | <i>2,64 %</i>        |
| Kommunikationsdienstleistungen                        | 4,22 %               |
| Industriegüter  | 5,98 %               |
| Immobilien  | 2,70 %               |
| Zyklische Konsumgüter                                 | 2,93 %               |
| Energie   | 2,11 %               |
| <i>Integrierter Öl- und Gaskonzern</i>                | <i>1,21 %</i>        |
| <i>Exploration und Produktion von Öl und Gas</i>      | <i>0,50 %</i>        |
| <i>Lagerung und Transport von Öl und Gas</i>          | <i>0,41 %</i>        |
| Grundstoffe   | 1,28 %               |
| Informationstechnologie                               | 0,84 %               |
| Gesundheitswesen                                      | 0,83 %               |
| Basiskonsumgüter                                      | 0,12 %               |
| Barmittel und Derivate                                | 2,12 %               |
| Summe   | 100,00 %             |

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:



### Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

Der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen ist in den obigen Feldern zur Vermögensallokation ersichtlich.

### Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

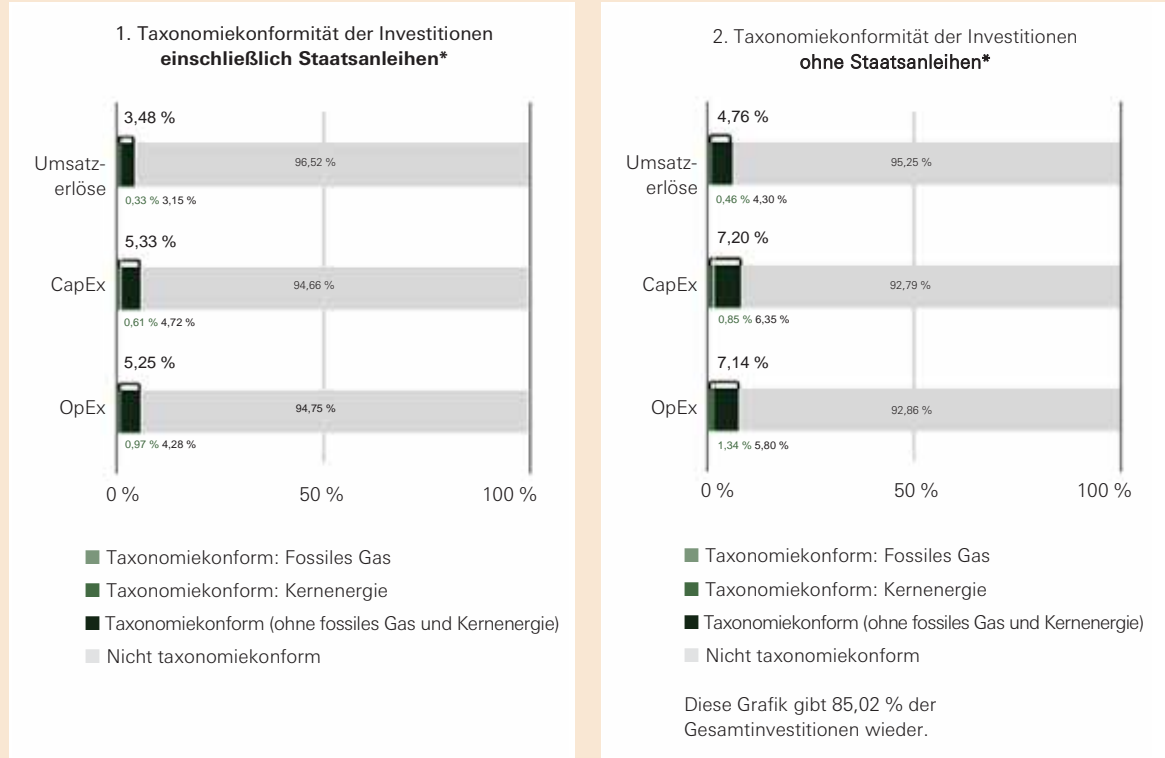
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen.

- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

**Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

**Ermöglichte Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

**Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.**



\* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Im Referenzzeitraum betrug der Anteil der Investitionen des Fonds, die in Übergangstätigkeiten geflossen sind, 0,33 % und der Anteil der Investitionen, die in ermöglichende Tätigkeiten geflossen ist, 1,04 %.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

| Indikator   | 2023-2024 | 2022-2023 |
|---|-----------|-----------|
| Umsatz – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                       | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform: Kernenergie                        | 0,33 %    | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie) | 3,15 %    | 0,00 %    |
| Umsatz – Nicht taxonomiekonform                               | 96,52 %   | 100,00 %  |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                        | 0,00 %    | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                         | 0,61 %    | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)  | 4,72 %    | 0,00 %    |
| CAPEX – Nicht taxonomiekonform                                | 94,66 %   | 100,00 %  |
| OPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                         | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                          | 0,97 %    | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)   | 4,28 %    | 0,00 %    |
| OPEX – Nicht taxonomiekonform                                 | 94,75 %   | 100,00 %  |

Da es sich erst um den zweiten Berichtszeitraum des Teilfonds handelt, ist ein Vergleich mit der Zeit davor nicht erforderlich.



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?**

Der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel war 28,23 %. Aufgrund der mangelnden Abdeckung und der fehlenden Daten hat sich der Teilfonds nicht verpflichtet, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen.



### **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Teilfonds investierte nicht in sozial nachhaltige Anlagen.



### **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

#2 Andere Investitionen umfasst die Finanzinstrumente, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden. In manchen Fällen ist dies auf die Nichtverfügbarkeit von Daten und Unternehmensmaßnahmen zurückzuführen. Diese Positionen unterlagen nach wie vor dem vollständigen Ausschluss-Screening von HSBC und wurden im Hinblick auf verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Prinzipien des UNGC und der OECD geprüft.

Der Teilfonds hielt Barmittel / Barmitteläquivalente (der Prozentsatz der gehaltenen Barmittel ist in der obigen Tabelle der Sektoren/Teilektoren unter der Überschrift „In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?“ ersichtlich) zum Zwecke des Liquiditätsmanagements sowie derivative Finanzinstrumente zum Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements. Barmittel / Barmitteläquivalente und derivative Finanzinstrumente verfügen aufgrund der Art dieser Instrumente über keinen ökologischen oder sozialen Mindestschutz.



### **Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?**

Im Laufe des Berichtszeitraums schloss der Anlageberater unter anderem verbotene Waffen, umstrittene Waffen, Unternehmen, die mehr als 10 % ihres Umsatzes aus Kraftwerkskohle und Energieerzeugung aus Kohle generieren, und Tabakherstellung aus und investierte in Unternehmen mit verantwortungsvollen Geschäftspraktiken gemäß den Prinzipien des UNGC.

Nach der Identifizierung des zulässigen Anlageuniversums konstruierte der Anlageberater ein Portfolio, dessen CO<sub>2</sub>-Intensität (berechnet als gewichteter Durchschnitt der CO<sub>2</sub>-Intensitäten der Anlagen des Teilfonds) niedriger ist als der gewichtete Durchschnitt der Bestandteile des Referenzwerts. Dies führte zu einem PAI-Score, der unter dem Referenzwert lag. Der Teilfonds bewertete auch ESG-Scores mit dem Ergebnis, dass der ESG-Score während des gesamten Berichtszeitraums über dem des Referenzwerts lag.

Darüber hinaus wurden alle Positionen auf Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der OECD untersucht, um Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung innerhalb des Portfolios sicherzustellen.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend.

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?**

Nicht zutreffend.

● **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?**

Nicht zutreffend.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Name des Produkts: HSBC GLOBAL INVESTMENT FUNDS - GLOBAL CORPORATE BOND

Unternehmenskennung (LEI-Code): 5493000IOBSL9ETYLK03

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

| ●● <input type="checkbox"/> Ja  | ●○ <input checked="" type="checkbox"/> Nein  |
|---|--|
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel</b> getätigt: _ % <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> </ul> | <input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit <b>ökologische/soziale Merkmale beworben</b> und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 21,97 % an nachhaltigen Investitionen <ul style="list-style-type: none"> <li><input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel</li> </ul> |
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel</b> getätigt: _ %   | <input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine <b>nachhaltigen Investitionen getätigt</b>  |



### Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Während des Geschäftsjahres zum 31. März 2024 (der Bezugszeitraum) bewarb der Teilfonds die folgenden Merkmale:

- Der Teilfonds investierte in Wertpapiere, die Klimaschutz- oder umweltschutzbezogene Projekte unterstützten.
- Der Teilfonds berücksichtigte verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Grundsätzen des Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC) und den Leitsätzen für multinationale Unternehmen der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für Unternehmen. Wurden potenzielle

Verstöße gegen die Prinzipien des UNGC festgestellt, wurden die Emittenten einer eigenen Due-Diligence-Prüfung hinsichtlich ESG-Themen unterzogen, um festzustellen, ob sie für die Aufnahme in das Portfolio des Teilfonds geeignet sind, und sie auszuschließen, falls sie als ungeeignet erachtet wurden.

3. Der Teilfonds schloss Geschäftstätigkeiten aus, die als umweltschädlich gelten, wie z. B. die Förderung von Kraftwerkskohle und die Kohleverstromung.
4. Der Teilfonds prüfte und analysierte alle Unternehmen oder Emittenten im Hinblick auf ökologische Merkmale, insbesondere physische Risiken durch den Klimawandel und Personalmanagement.
5. Der Teilfonds berücksichtigte aktiv ökologische und soziale Aspekte, indem er über unsere Engagement- und Stewardship-Teams Mitwirkung bei Emittenten umsetzte, wo HSBC Asset Management dies für angemessen hielt.
6. Der Teilfonds schloss nach entsprechender Analyse Anlagen in umstrittenen Waffen aus.

Die ESG-Scores stammen vom externen ESG-Datenanbieter MSCI. Die Berücksichtigung einzelner (in der nachstehenden Tabelle nummerierter) wichtigster nachteiliger Auswirkungen (PAI) drückt sich darin aus, dass der Teilfonds niedrigere Werte als der Referenzwert aufweist. Die bei der Berechnung der PAI-Werte verwendeten Daten stammen von externen Datenanbietern. Sie können auf Emittentenangaben basieren oder von den Datenanbietern geschätzt werden, wo keine solchen Emittentenangaben vorliegen. Bitte beachten Sie, dass es nicht immer möglich ist, die Richtigkeit, Aktualität oder Vollständigkeit der von Drittanbietern bereitgestellten Daten zu garantieren.

Der Referenzwert wurde für den Marktvergleich herangezogen, diente aber nicht der Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale des Teilfonds.

Das Abschneiden der Nachhaltigkeitsindikatoren, die der Teilfonds zur Messung der Erreichung der von ihm beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet, ist in der folgenden Tabelle dargestellt. Es wurde auf das Erreichen eines ESG-Score des Teilfonds hingearbeitet, der über dem vom Teilfonds ausgewählten Referenzindex liegt (ein höherer Score als der Referenzwert bedeutet bessere ESG-Referenzen).

Alle Unternehmen/Emittenten haben eine gute Unternehmensführung bewiesen, was sich am PAI-Score 10 unten ablesen lässt.

### **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

| <b>Indikator</b>   | <b>Fonds</b> | <b>Referenzwert</b> |
|--|--------------|---------------------|
| ESG-Score  | 7,25         | 7,19                |
| E-Säule  | 7,58         | 7,50                |
| S-Säule  | 5,32         | 5,09                |
| G-Säule  | 5,99         | 5,84                |
| Treibhausgasintensität (Scope 1 & 2)   | 73,68        | 98,87               |
| Ausschlüsse (UNGC/OECD)  | 0,67         | 0,35                |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente pro Million Euro Umsatz   | 73,68        | 98,87               |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 0,66 %       | 0,35 %              |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 0,00 %       | 0,00 %              |

Die Daten in diesem regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung beziehen sich auf den Stand vom 31. März 2024, basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des am 31. März 2024 endenden Geschäftsjahres.

Referenzwert - Global Aggregate Corporates AWS Index

### **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

| <b>Indikator</b>   | <b>Zeitraum zum</b> | <b>Fonds</b> | <b>Referenzwert</b> |
|--|---------------------|--------------|---------------------|
| ESG-Score  | 31. März 2024       | 7,25         | 7,19                |
|  | 31. März 2023       | 7,01         | 6,98                |
| E-Säule  | 31. März 2024       | 7,58         | 7,50                |
|  | 31. März 2023       | 0,00         | 0,00                |
| S-Säule  | 31. März 2024       | 5,32         | 5,09                |
|  | 31. März 2023       | 0,00         | 0,00                |
| G-Säule  | 31. März 2024       | 5,99         | 5,84                |
|  | 31. März 2023       | 0,00         | 0,00                |
| Treibhausgasintensität (Scope 1 & 2)   | 31. März 2024       | 73,68        | 98,87               |
|  | 31. März 2023       | 0,00         | 0,00                |
| Ausschlüsse (UNGC/OECD)  | 31. März 2024       | 0,67         | 0,35                |
|  | 31. März 2023       | 0,00         | 0,00                |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente pro Million Euro Umsatz   | 31. März 2024       | 73,68        | 98,87               |
|  | 31. März 2023       | 115,22       | 188,40              |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 31. März 2024       | 0,66 %       | 0,35 %              |
|  | 31. März 2023       | 1,01 %       | 1,89 %              |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 31. März 2024       | 0,00 %       | 0,00 %              |
|  | 31. März 2023       | 0,00 %       | 0,00 %              |

Da es sich erst um den zweiten regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung handelt, ist kein Vergleich mit vorangegangenen Zeiträumen möglich.

### **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die vom Teilfonds getätigten nachhaltigen Investitionen trugen unter anderem zu folgenden ökologischen Zielen bei:

1. Reduzierung von Treibhausgasemissionen und Verringerung des CO<sub>2</sub>-Fußabdrucks;
2. Übergang zu oder die Nutzung von erneuerbarer Energie.

Der Fonds bezog die Identifizierung und Analyse der ESG-Referenzen eines Emittenten als integralen Bestandteil in den Anlageentscheidungsprozess ein, um die Bewertung von Risiken und potenziellen Renditen zu unterstützen.

Der Anlageberater zielt darauf ab, durch Berücksichtigung der ESG-Referenzen potenzieller Investitionen einen besseren ESG-Score zu erzielen als der Referenzwert.

### **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Wir bestätigen, dass wir nachhaltige Vermögenswerte darauf geprüft haben, ob sie erhebliche Beeinträchtigungen verursachen können. Dies erfolgte im Rahmen des Standard-Anlageprozesses von HSBC Asset Management (HSBC) und unter Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen.



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?*

Der Anlageberater hat alle durch die Offenlegungsverordnung definierten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI) auf ihre Relevanz für den Teilfonds geprüft. Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren legt fest, wie HSBC die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen identifiziert und darauf reagiert, und in welcher Form HSBC Nachhaltigkeitsrisiken berücksichtigt, die sich negativ auf Wertpapiere auswirken können, in die der Teilfonds investiert. HSBC identifizierte in Zusammenarbeit mit externen Screening-Dienstleistern, wie Sustainalytics, ISS, MSCI und Trucost, Unternehmen und Regierungen mit schlechter Bilanz beim Management von ESG-Risiken, und wo solche wesentlichen Risiken identifiziert wurden, führte HSBC zusätzliche ESG-Due-Diligence-Prüfungen durch. Durch Screening identifizierte Nachhaltigkeitsauswirkungen einschließlich der PAI bildeten einen Schlüsselfaktor beim Anlageentscheidungsprozess.

Der oben beschriebene Ansatz führte dazu, dass unter anderem folgende Faktoren geprüft wurden:

- Engagement der Unternehmen für den Übergang zu CO2-armen Wirtschaften, zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern, Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus großen Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails; und
- Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit folgenden Bereichen: demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.

Die spezifischen PAI für diesen Teilfonds waren wie unten beschrieben.

Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren ist auf der Website <http://www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies> verfügbar.

### *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:*

HSBC hat sich der Anwendung und Förderung globaler Standards verpflichtet. Die wichtigsten Schwerpunktbereiche der Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren entsprachen den zehn UNGC-Grundsätzen. Diese Grundsätze stehen in Zusammenhang mit nicht finanziellen Risiken in den Bereichen Menschenrechte, Arbeit, Umweltschutz und Korruptionsbekämpfung. HSBC gehört darüber hinaus zu den Unterzeichnern der UN Principles for Responsible Investment. Diese bildeten den Rahmen für Ermittlung und Management von Nachhaltigkeitsrisiken beim Investmentansatz von HSBC.

Von Unternehmen, in die der Teilfonds investierte, wurde erwartet, dass sie die Anforderungen des UNGC und der damit verbundenen Standards erfüllen. Unternehmen, die belegbar gegen einen der zehn Grundsätze des UNGC verstießen, wurden systematisch ausgeschlossen. Der Teilfonds führte verstärkte Due-Diligence-Prüfungen bei Unternehmen durch, die als nicht konform mit den Prinzipien des UNGC angesehen wurden oder die nach den unternehmenseigenen ESG Ratings von HSBC als risikoreich angesehen wurden. Darüber hinaus wurden die Unternehmen nach internationalen Standards wie den OECD-Leitsätzen bewertet.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen. Hierbei gelten spezifische von der Union definierte Kriterien.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*



### **Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Der Teilfonds berücksichtigte die folgenden PAI, indem er sie als Nachhaltigkeitsindikatoren beobachtete:

- Treibhausgasintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1 und Scope 2)
- Verstöße gegen die UNGC- und OECD-Grundsätze
- Anteil der Investitionen mit Beteiligung an umstrittenen Waffen

Der Ansatz zur Berücksichtigung der PAI beinhaltete unter anderem, dass HSBC das Engagement der Unternehmen für den Übergang zu CO<sub>2</sub>-armen Wirtschaften, die zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern sowie die Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette prüfte, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails. Ebenfalls berücksichtigt wurde das Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit den Bereichen demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.

Das Screening führte dazu, dass HSBC nicht in bestimmte Unternehmen und Emittenten investierte.



## Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** Investitionen entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden: basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des Bezugszeitraums zum 31.03.2024

| Größte Investitionen   | Sektor                | % der Vermögenswerte | Land  |
|--|-----------------------|----------------------|---|
| HSBC Global Investment Funds SICAV - Global Investment Grade Securitised Credit Bond ZC Capitalisation | Andere                | 2,12 %               | Luxemburg   |
| Credit Suisse Ag, New York Branch Frn 21.02.2025   | Finanzen              | 0,91 %               | Schweiz   |
| Bank Of America Corporation 2,972 % 04.02.2033   | Finanzen              | 0,85 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| Government Of The United States Of America 4,0 % 15.11.2052  | Staatsanleihen        | 0,84 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| Bank Of Montreal 5,3 % 05.06.2026  | Finanzen              | 0,76 %               | Kanada  |
| Aircastle Limited 5,25 % 11.08.2025  | Industriegüter        | 0,74 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| Standard Chartered Plc Frn 30.03.2026  | Finanzen              | 0,74 %               | Vereinigtes Königreich von Großbritannien und Nordirland. |
| General Motors Financial Company, Inc. Frn 07.04.2025  | Zyklische Konsumgüter | 0,65 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| Waste Management, Inc. 4,875 % 15.02.2029  | Industriegüter        | 0,58 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| Aercap Ireland Capital Dac 3,5 % 15.01.2025  | Finanzen              | 0,54 %               | Irland  |
| Equinix, Inc. 1,45 % 15.05.2026  | Immobilien            | 0,52 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| Targa Resources Corp. 4,95 % 15.04.2052  | Energie               | 0,52 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| Constellation Brands, Inc. 4,35 % 09.05.2027   | Basiskonsumgüter      | 0,50 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| Booking Holdings Inc. 4,75 % 15.11.2034  | Zyklische Konsumgüter | 0,49 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| L'oreal S.a. 3,125 % 19.05.2024  | Basiskonsumgüter      | 0,49 %               | Frankreich  |

Barmittel und Derivate wurden nicht berücksichtigt

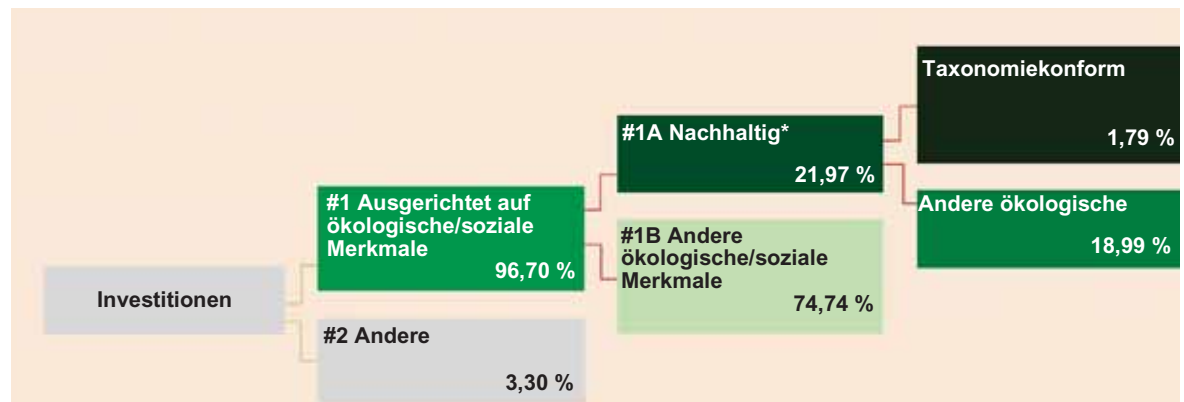


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

21,97 % des Portfolios waren in nachhaltige Vermögenswerte investiert.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

### ● *Wie sah die Vermögensallokation aus?*



**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**#2 Andere Investitionen** umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

\* Ein Unternehmen oder Emittent, das bzw. der als nachhaltige Investition angesehen wird, kann sowohl zu einem sozialen als auch zu einem ökologischen Ziel beitragen, das an der EU-Taxonomie ausgerichtet sein kann oder nicht. Die Zahlen in der obigen Grafik berücksichtigen dies. Jedoch darf eine Gesellschaft oder ein Emittent unter dem Punkt der nachhaltigen Investitionen (#1A Nachhaltige Investitionen) nur einmal erfasst werden.

Die Prozentzahlen von taxonomiekonformen Investitionen und Andere ökologische Merkmale stimmen aufgrund der unterschiedlichen Berechnungsmethoden für nachhaltige Investitionen und taxonomiekonforme Investitionen nicht mit #1A Nachhaltige Investitionen überein.

## In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

| Sektor / Teilsektor                              | % der Vermögenswerte |
|--|----------------------|
| Finanzen   | 38,70 %              |
| Andere   | 19,02 %              |
| <i>Erdgas</i>                                    | <i>0,68 %</i>        |
| <i>Lagerung und Transport von Öl und Gas</i>     | <i>0,81 %</i>        |
| Staatsanleihen                                   | 8,51 %               |
| Kommunikationsdienstleistungen                   | 5,26 %               |
| Industriegüter                                   | 5,10 %               |
| Versorger  | 4,60 %               |
| <i>Stromversorgungsbetriebe</i>                  | <i>2,73 %</i>        |
| <i>Erdgas</i>                                    | <i>0,18 %</i>        |
| <i>Multi-Versorger</i>                           | <i>1,22 %</i>        |
| Basiskonsumgüter                                 | 4,15 %               |
| Zyklische Konsumgüter                            | 3,25 %               |
| Gesundheitswesen                                 | 2,94 %               |
| Informationstechnologie                          | 2,70 %               |
| Immobilien                                       | 2,55 %               |
| Energie  | 2,49 %               |
| <i>Integrierter Öl- und Gaskonzern</i>           | <i>0,96 %</i>        |
| <i>Exploration und Produktion von Öl und Gas</i> | <i>0,21 %</i>        |
| <i>Lagerung und Transport von Öl und Gas</i>     | <i>1,32 %</i>        |
| Grundstoffe                                      | 1,12 %               |
| Barmittel und Derivate                           | -0,41 %              |
| Summe  | 100,00 %             |



### Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

Der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen ist in den obigen Feldern zur Vermögensallokation ersichtlich.

#### Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonmiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonmiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonmiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Mit Blick auf die EU-Taxonmiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Taxonmiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

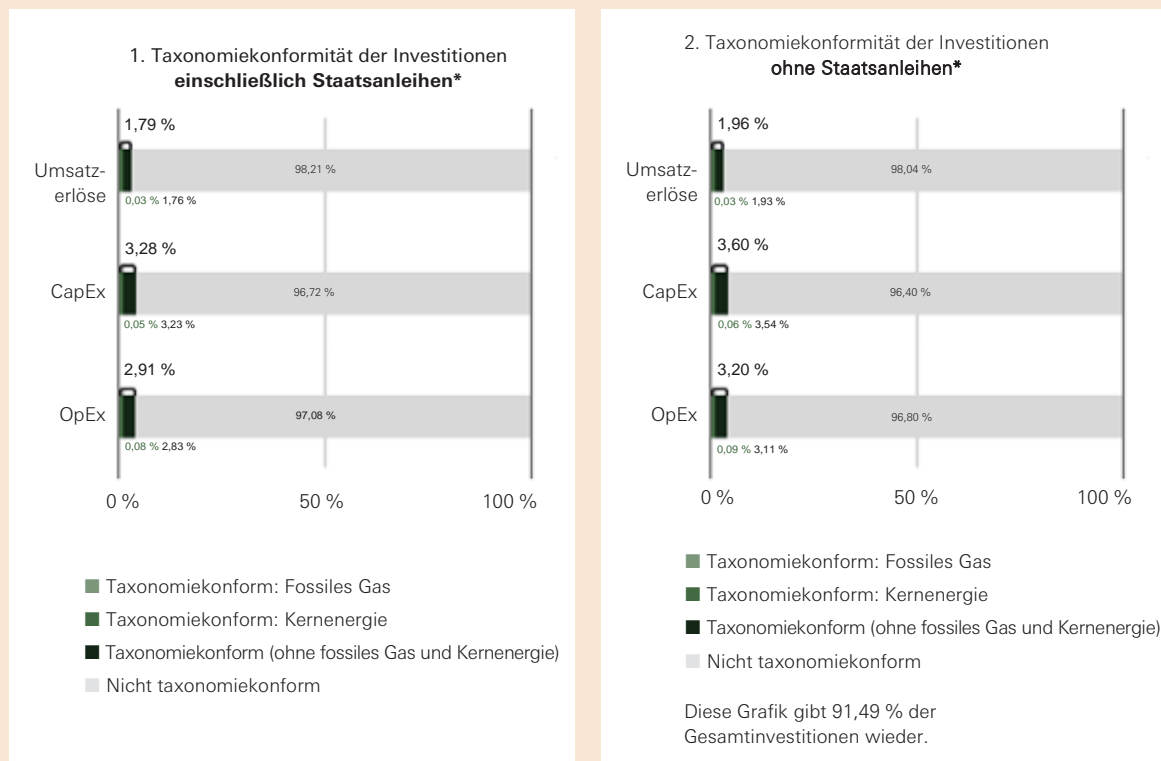
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen.

- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

**Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

**Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.**



\* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Im Referenzzeitraum betrug der Anteil der Investitionen des Fonds, die in Übergangstätigkeiten geflossen sind, 0,03 % und der Anteil der Investitionen, die in ermöglichende Tätigkeiten geflossen ist, 1,52 %.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

| Indikator   | 2023-2024 | 2022-2023 |
|---|-----------|-----------|
| Umsatz – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                       | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform: Kernenergie                        | 0,03 %    | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie) | 1,76 %    | 0,00 %    |
| Umsatz – Nicht taxonomiekonform                               | 98,21 %   | 100,00 %  |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                        | n. z.     | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                         | 0,05 %    | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)  | 3,23 %    | 0,00 %    |
| CAPEX – Nicht taxonomiekonform                                | 96,72 %   | 100,00 %  |
| OPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                         | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                          | 0,08 %    | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)   | 2,83 %    | 0,00 %    |
| OPEX – Nicht taxonomiekonform                                 | 97,08 %   | 100,00 %  |

Da es sich erst um den zweiten Berichtszeitraum des Teilfonds handelt, ist ein Vergleich mit der Zeit davor nicht erforderlich.



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?**

Der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel war 18,99 %. Der Teilfonds hat sich nicht verpflichtet, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen.



### **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Teilfonds investierte nicht in sozial nachhaltige Anlagen.



### **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

#2 Andere Investitionen umfasst die Finanzinstrumente, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden. In manchen Fällen ist dies auf die Nichtverfügbarkeit von Daten und Unternehmensmaßnahmen zurückzuführen. Diese Positionen unterlagen nach wie vor dem vollständigen Ausschluss-Screening von HSBC und wurden im Hinblick auf verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Prinzipien des UNGC und der OECD geprüft.

Der Teilfonds hielt Barmittel / Barmitteläquivalente (der Prozentsatz der gehaltenen Barmittel ist in der obigen Tabelle der Sektoren/Teilektoren unter der Überschrift „In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?“ ersichtlich) zum Zwecke des Liquiditätsmanagements sowie derivative Finanzinstrumente zum Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements. Barmittel / Barmitteläquivalente und derivative Finanzinstrumente verfügen aufgrund der Art dieser Instrumente über keinen ökologischen oder sozialen Mindestschutz.



### **Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?**

Im Laufe des Berichtszeitraums schloss der Anlageberater unter anderem verbotene Waffen, umstrittene Waffen, Unternehmen, die mehr als 10 % ihres Umsatzes aus Kraftwerkskohle und Energieerzeugung aus Kohle generieren, und Tabakherstellung aus und investierte in Unternehmen mit verantwortungsvollen Geschäftspraktiken gemäß den Prinzipien des UNGC.

Alle Positionen des Portfolios wurden hinsichtlich ihrer individuellen Treibhausgasintensität bewertet, was zu einem PAI-Wert führte, der unter dem des Referenzwerts lag. Der Teilfonds bewertete auch ESG-Scores mit dem Ergebnis, dass der ESG-Score während des gesamten Berichtszeitraums vergleichbar mit dem des Referenzwerts war.

Darüber hinaus wurden alle Positionen auf Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der OECD untersucht, um Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung innerhalb des Portfolios sicherzustellen.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Nicht zutreffend.

- **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?**

Nicht zutreffend.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.



Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen 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.

Name des Produkts: HSBC GLOBAL INVESTMENT FUNDS - GLOBAL EMERGING MARKETS ESG BOND

Unternehmenskennung (LEI-Code): 213800GKT3144FMKDN91

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

**Ja**

- Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: \_ %
  - in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
  - in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: \_ %

**Nein**

- Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 17,56 % an nachhaltigen Investitionen
  - mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
  - mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
  - mit einem sozialen Ziel
- Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt**



### Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Während des Geschäftsjahres zum 31. März 2024 (der Bezugszeitraum) bewarb der Teilfonds die folgenden Merkmale:

1. Der Teilfonds investierte in Wertpapiere, die Klimaschutz- oder umweltschutzbezogene Projekte unterstützten.
2. Der Teilfonds berücksichtigte verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Grundsätzen des Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC) und den Leitsätzen für multinationale Unternehmen der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für Unternehmen. Wurden potenzielle Verstöße gegen die Prinzipien des UNGC festgestellt, wurden die Emittenten einer

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

eigenen Due-Diligence-Prüfung hinsichtlich ESG-Themen unterzogen, um festzustellen, ob sie für die Aufnahme in das Portfolio des Teilfonds geeignet sind, und sie auszuschließen, falls sie als ungeeignet erachtet wurden.

3. Der Teilfonds schloss Geschäftstätigkeiten aus, die als umweltschädlich gelten, wie z. B. die Förderung von Kraftwerkskohle und die Kohleverstromung.
4. Der Teilfonds prüfte und analysierte alle Unternehmen oder Emittenten im Hinblick auf ökologische Merkmale, insbesondere physische Risiken durch den Klimawandel und Personalmanagement.
5. Der Teilfonds berücksichtigte aktiv ökologische und soziale Aspekte, indem er über unsere Engagement- und Stewardship-Teams Mitwirkung bei Emittenten umsetzte, wo HSBC Asset Management dies für angemessen hielt.
6. Der Teilfonds schloss nach entsprechender Analyse Anlagen in umstrittenen Waffen aus.

Die auf ESG und Nachhaltigkeitsindikatoren bezogenen Scores werden anhand der proprietären Methodik von HSBC Asset Management und externer ESG-Datenanbieter berechnet. Wir verwenden ESG-Scores von Drittanbietern (z. B. ESG-Scores von MSCI) und haben auch eigene Scores entwickelt, um unsere eigene Sicht der ESG-Risiken und -Chancen widerzuspiegeln. Wir haben eine maßgeschneiderte Branchensegmentierung entwickelt (abgeleitet vom MSCI Global Industry Classification Standard), bei der wir die Wesentlichkeit der wichtigsten E-, S- und G-Faktoren von MSCI auf einer sektoralen Basis neu bewerten und eine sektorspezifische HSBC-ESG-Gewichtung erstellen.

Die Berücksichtigung einzelner wichtigster nachteiliger Auswirkungen (PAI) wird in der nachstehenden Tabelle anhand ihrer Nummerierung im Vergleich zum Referenzwert angegeben. Die bei der Berechnung der PAI-Werte verwendeten Daten stammen von externen Datenanbietern. Sie können auf Unternehmens-/Emittentenangaben basieren oder von den Datenanbietern geschätzt werden, wo keine solchen Angaben vorliegen. Bitte beachten Sie, dass es nicht immer möglich ist, die Richtigkeit, Aktualität oder Vollständigkeit der von Drittanbietern bereitgestellten Daten zu garantieren. Der Referenzwert wurde für den Marktvergleich herangezogen, diente aber nicht der Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale des Teilfonds.

Das Abschneiden der Nachhaltigkeitsindikatoren, die der Teilfonds zur Messung der Erreichung der von ihm beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet, ist in der folgenden Tabelle dargestellt. Es wurde auf das Erreichen eines ESG-Score des Teilfonds hingearbeitet, der über dem vom Teilfonds ausgewählten Referenzindex liegt (ein höherer Score als der Referenzwert bedeutet bessere ESG-Referenzen).

Alle Unternehmen/Emittenten haben eine gute Unternehmensführung bewiesen, was sich am PAI-Score 10 unten ablesen lässt.

### **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

| <b>Indikator</b>   | <b>Teilfonds</b> | <b>Referenzwert</b> |
|--|------------------|---------------------|
| ESG-Score  | 4,71             | 4,24                |
| E-Säule  | 5,39             | 5,08                |
| S-Säule  | 5,78             | 5,71                |
| G-Säule  | 5,50             | 5,46                |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente pro Million Euro Umsatz   | 374,23           | 94,05               |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 0,00 %           | 1,38 %              |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen,  | 0,00 %           | 0,00 %              |

Die Daten in diesem regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung beziehen sich auf den Stand vom 31. März 2024, basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des am 31. März 2024 endenden Geschäftsjahres.

Referenzwert - J.P.Morgan ESG EMBI Global Diversified

**... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

| Indikator  | Zeitraum zum  | Teilfonds | Referenzwert |
|--|---------------|-----------|--------------|
| ESG-Score  | 31. März 2024 | 4,71      | 4,24         |
|  | 31. März 2023 | 4,79      | 4,28         |
| E-Säule  | 31. März 2024 | 5,39      | 5,08         |
|  | 31. März 2023 | 5,30      | 4,98         |
| S-Säule  | 31. März 2024 | 5,78      | 5,71         |
|  | 31. März 2023 | 5,62      | 5,38         |
| G-Säule  | 31. März 2024 | 5,50      | 5,46         |
|  | 31. März 2023 | 5,06      | 4,94         |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO2-Äquivalente pro Million Euro Umsatz  | 31. März 2024 | 374,23    | 94,05        |
|  | 31. März 2023 | 239,18    | 160,54       |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 31. März 2024 | 0,00 %    | 1,38 %       |
|  | 31. März 2023 | 0,00 %    | 1,45 %       |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 31. März 2024 | 0,00 %    | 0,00 %       |
|  | 31. März 2023 | 0,00 %    | 0,00 %       |

Da es sich erst um den zweiten regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung handelt, ist kein Vergleich mit vorangegangenen Zeiträumen möglich.

**Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die vom Teilfonds getätigten nachhaltigen Investitionen trugen unter anderem zu folgenden ökologischen Zielen bei:

1. Reduzierung von Treibhausgasemissionen und Verringerung des CO2-Fußabdrucks;
2. Übergang zu oder die Nutzung von erneuerbarer Energie.

Der Teilfonds bezog die Identifizierung und Analyse der ESG-Referenzen eines Unternehmens als integralen Bestandteil in den Anlageentscheidungsprozess ein, um die Bewertung von Risiken und potenziellen Renditen zu unterstützen.

**Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Wir bestätigen, dass wir nachhaltige Vermögenswerte darauf geprüft haben, ob sie erhebliche Beeinträchtigungen verursachen können. Dies erfolgte im Rahmen des Standard-Anlageprozesses von HSBC Asset Management (HSBC) und unter Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen.

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?*

Der Anlageberater hat alle durch die Offenlegungsverordnung definierten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI) auf ihre Relevanz für den Teilfonds geprüft. Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren legt fest, wie HSBC die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen identifiziert und darauf reagiert, und in welcher Form HSBC Nachhaltigkeitsrisiken berücksichtigt, die sich negativ auf Wertpapiere auswirken können, in die der Teilfonds investiert. HSBC identifizierte in Zusammenarbeit mit externen Screening-Dienstleistern, wie Sustainalytics, ISS, MSCI und Trucost, Unternehmen und Regierungen mit schlechter Bilanz beim Management von ESG-Risiken, und wo solche wesentlichen Risiken identifiziert wurden, führte HSBC zusätzliche ESG-Due-Diligence-Prüfungen durch. Durch Screening identifizierte Nachhaltigkeitsauswirkungen einschließlich der PAI bildeten einen Schlüsselfaktor beim Anlageentscheidungsprozess.

Der oben beschriebene Ansatz führte dazu, dass unter anderem folgende Faktoren geprüft wurden:

- Engagement der Unternehmen für den Übergang zu CO<sub>2</sub>-armen Wirtschaften, zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern, Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus großen Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails; und
- Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit folgenden Bereichen: demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.

Die spezifischen PAI für diesen Teilfonds waren wie unten beschrieben.

Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren ist auf der Website [www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies](http://www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies) verfügbar.

## *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:*

HSBC hat sich der Anwendung und Förderung globaler Standards verpflichtet. Die wichtigsten Schwerpunktbereiche der Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren entsprachen den zehn UNGC-Grundsätzen. Diese Grundsätze stehen in Zusammenhang mit nicht finanziellen Risiken in den Bereichen Menschenrechte, Arbeit, Umweltschutz und Korruptionsbekämpfung. HSBC gehört darüber hinaus zu den Unterzeichnern der UN Principles for Responsible Investment. Diese bildeten den Rahmen für Ermittlung und Management von Nachhaltigkeitsrisiken beim Investmentansatz von HSBC.

Von Unternehmen, in die der Teilfonds investierte, wurde erwartet, dass sie die

Anforderungen des UNGC und der damit verbundenen Standards erfüllen. Unternehmen, die belegbar gegen einen der zehn Grundsätze des UNGC verstießen, wurden systematisch ausgeschlossen. Der Teilfonds führte verstärkte Due-Diligence-Prüfungen bei Unternehmen durch, die als nicht konform mit den Prinzipien des UNGC angesehen wurden oder die nach den unternehmenseigenen ESG Ratings von HSBC als risikoreich angesehen wurden. Darüber hinaus wurden die Unternehmen nach internationalen Standards wie den OECD-Leitsätzen bewertet.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen. Hierbei gelten spezifische von der Union definierte Kriterien.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*



### **Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Die vom Teilfonds berücksichtigte wichtigste nachteilige Auswirkungen waren:

- Treibhausgasintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1 und Scope 2)
- Verstöße gegen die UNGC- und OECD-Grundsätze
- Anteil der Investitionen mit Beteiligung an umstrittenen Waffen

Der Ansatz zur Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen beinhaltete unter anderem, dass HSBC das Engagement der Unternehmen für den Übergang zu kohlenstoffarmem Wirtschaften, die zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern sowie die Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette prüfte, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails. Ebenfalls berücksichtigt wurde das Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit den Bereichen demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.

Das Screening führte dazu, dass HSBC nicht in bestimmte Unternehmen und Emittenten investierte.



## Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** Investitionen entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden: basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des Bezugszeitraums zum 31.03.2024

| Größte Investitionen   | Sektor         | % der Vermögenswerte | Land                           |
|--|----------------|----------------------|--------------------------------|
| Government Of Uruguay 5,1 %<br>18.06.2050                        | Staatsanleihen | 2,07 %               | Uruguay                        |
| Government Of Uruguay 5,75 %<br>28.10.2034                       | Staatsanleihen | 2,04 %               | Uruguay                        |
| Government Of The United States Of America 4,125 %<br>15.11.2032 | Staatsanleihen | 1,77 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Government Of Germany 4,34 %<br>07.03.2042                       | Staatsanleihen | 1,42 %               | Chile                          |
| Government Of Brazil 10,0 %<br>01.01.2033                        | Staatsanleihen | 1,30 %               | Brasilien                      |
| Government Of The United States Of America 4,0 %<br>15.11.2052   | Staatsanleihen | 1,30 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Government Of Costa Rica 6,125 %<br>19.02.2031                   | Staatsanleihen | 1,29 %               | Costa Rica                     |
| Jsc National Company Kazmunaygas 4,75 %<br>19.04.2027            | Energie        | 1,12 %               | Kasachstan                     |
| Government Of Hungary 6,75 %<br>25.09.2052                       | Staatsanleihen | 1,11 %               | Ungarn                         |
| Ecopetrol S.a. 8,875 %<br>13.01.2033                             | Energie        | 1,04 %               | Kolumbien                      |
| Government Of Peru 3,0 %<br>15.01.2034                           | Staatsanleihen | 1,04 %               | Peru                           |
| Government Of Hungary 6,125 %<br>22.05.2028                      | Staatsanleihen | 1,02 %               | Ungarn                         |
| Government Of Ivory Coast 6,125 %<br>15.06.2033                  | Staatsanleihen | 0,99 %               | Cote d'Ivoire                  |
| Government Of Romania 5,25 %<br>25.11.2027                       | Staatsanleihen | 0,97 %               | Rumänien                       |
| Government Of The Dominican Republic 6,4 %<br>05.06.2049         | Staatsanleihen | 0,96 %               | Dominikanische Republik        |

Barmittel und Derivate wurden nicht berücksichtigt

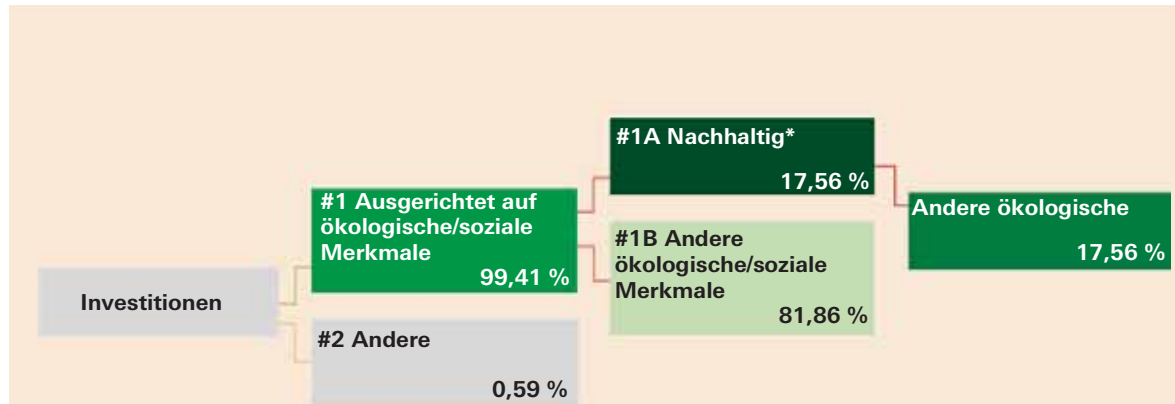


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

17,56 % des Portfolios waren in nachhaltige Vermögenswerte investiert.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?



**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**#2 Andere Investitionen** umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:  
 – Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.  
 – Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

### In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

| Sektor / Teilsektor                                   | % der Vermögenswerte |
|---|----------------------|
| Staatsanleihen  | 79,96 %              |
| Andere  | 8,15 %               |
| <i>Erdgas</i>   | 0,44 %               |
| <i>Ausrüstung und Dienstleistungen für Öl und Gas</i> | 1,16 %               |
| <i>Lagerung und Transport von Öl und Gas</i>          | 0,10 %               |
| Energie   | 7,84 %               |
| <i>Integrierter Öl- und Gaskonzern</i>                | 2,22 %               |
| <i>Ausrüstung und Dienstleistungen für Öl und Gas</i> | 0,50 %               |
| <i>Exploration und Produktion von Öl und Gas</i>      | 0,52 %               |
| <i>Raffination und Vertrieb von Öl und Gas</i>        | 2,49 %               |
| <i>Lagerung und Transport von Öl und Gas</i>          | 2,10 %               |
| Finanzen  | 4,79 %               |
| Versorger   | 3,15 %               |
| <i>Stromversorgungsbetriebe</i>                       | 1,16 %               |
| Industriegüter  | 1,87 %               |
| Grundstoffe   | 0,90 %               |
| Zyklische Konsumgüter                                 | 0,88 %               |
| Basiskonsumgüter                                      | 0,42 %               |
| Kommunikationsdienstleistungen                        | 0,12 %               |
| Barmittel und Derivate                                | -8,09 %              |
| Summe   | 100,00 %             |



## Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

Der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen lag bei 0 %. Der Teilfonds hat sich nicht verpflichtet, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen.

### Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomeikonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

Ja:
  In fossiles Gas
  In Kernenergie

Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomeikonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomeikonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Mit Blick auf die EU-Taxonomie-konformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

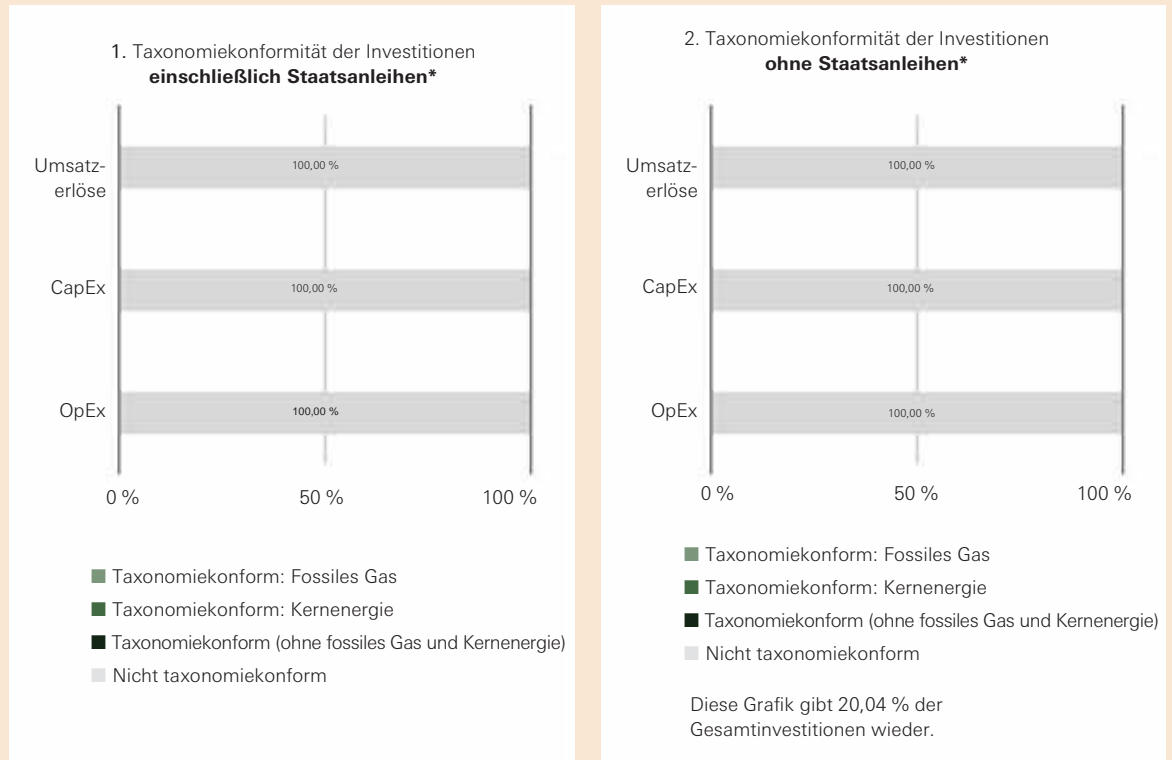
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen.

- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

### Übergangstätigkeiten

sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

*Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomeikonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.*



\* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

### Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Im Referenzzeitraum betrug der Anteil der Investitionen des Fonds, die in Übergangstätigkeiten geflossen sind, 0,00 % und der Anteil der Investitionen, die in ermöglichende Tätigkeiten geflossen ist, 0,00 %.




**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

| Indikator   | 2023-2024 | 2022-2023 |
|---|-----------|-----------|
| Umsatz – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                       | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform: Kernenergie                        | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie) | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Nicht taxonomiekonform                               | 100,00 %  | 100,00 %  |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                        | n. z.     | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                         | n. z.     | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)  | n. z.     | 0,00 %    |
| CAPEX – Nicht taxonomiekonform                                | 100,00 %  | 100,00 %  |
| OPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                         | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                          | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)   | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Nicht taxonomiekonform                                 | 100,00 %  | 100,00 %  |

Da es sich erst um den zweiten Berichtszeitraum des Teilfonds handelt, ist ein Vergleich mit der Zeit davor nicht erforderlich.

 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?**

Der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel war 17,56 %. Der Teilfonds hat sich nicht verpflichtet, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen.

 **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Teilfonds investierte nicht in sozial nachhaltige Anlagen.

 **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

#2 Andere Investitionen umfasst die Finanzinstrumente, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden. In manchen Fällen ist dies auf die Nichtverfügbarkeit von Daten und Unternehmensmaßnahmen zurückzuführen. Diese Positionen unterlagen nach wie vor dem vollständigen Ausschluss-Screening von HSBC und wurden im Hinblick auf verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Prinzipien des UNGC und der OECD geprüft.

Der Teilfonds hielt Barmittel / Barmitteläquivalente (der Prozentsatz der gehaltenen Barmittel ist in der obigen Tabelle der Sektoren/Teilektoren unter der Überschrift „In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?“ ersichtlich) zum Zwecke des Liquiditätsmanagements sowie derivative Finanzinstrumente zum Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements. Barmittel / Barmitteläquivalente und derivative Finanzinstrumente verfügen aufgrund der Art dieser Instrumente über keinen ökologischen oder sozialen Mindestschutz.



## Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Im Laufe des Berichtszeitraums schloss der Anlageberater unter anderem verbotene Waffen, umstrittene Waffen, Unternehmen, die mehr als 10 % ihres Umsatzes aus Kraftwerkskohle und Energieerzeugung aus Kohle generieren, und Tabakherstellung aus und investierte in Unternehmen mit verantwortungsvollen Geschäftspraktiken gemäß den Prinzipien des UNGC.

Alle Positionen des Portfolios wurden hinsichtlich ihrer individuellen Treibhausgasintensität bewertet. Der Teilfonds bewertete auch ESG-Scores mit dem Ergebnis, dass der ESG-Score während des gesamten Berichtszeitraums vergleichbar mit dem des Referenzwerts war.

Darüber hinaus wurden alle Positionen auf Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der OECD untersucht, um Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung innerhalb des Portfolios sicherzustellen.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend.

● **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Nicht zutreffend.

● **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?**

Nicht zutreffend.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen 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.

**Name des Produkts:** HSBC GLOBAL INVESTMENT FUNDS - GLOBAL EMERGING MARKETS ESG LOCAL DEBT

**Unternehmenskennung (LEI-Code):** 54930054ELQ4UKC2EY24

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

| ●● <input type="checkbox"/> Ja  | ●○ <input checked="" type="checkbox"/> Nein   |
|---|---|
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel</b> getätigt: _ % <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> </ul> | <input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit <b>ökologische/soziale Merkmale beworben</b> und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 21,40 % an nachhaltigen Investitionen <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel</li> </ul> |
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel</b> getätigt: _ %   | <input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt</b>   |

### Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?



Während des am 31. März 2024 endenden Geschäftsjahres (der Bezugszeitraum) hat der Teilfonds Folgendes beworben:

- Es wurde auf das Erreichen eines ESG-Score des Teilfonds hingearbeitet, der über dem vom Teilfonds ausgewählten Referenzindex liegt (ein höherer Score als der Referenzwert bedeutet bessere ESG-Referenzen). Für die zugrunde liegenden E-, S- und G-Säulen wurden ein Screening sowie ein Vergleich mit dem für den Teilfonds definierten Referenzwert durchgeführt. „E“ und „S“ spiegeln die einzelnen Elemente der vom Teilfonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale wider, „G“ die Unternehmensführungspraktiken, die die Interessen von Minderheitsaktionären schützen und eine langfristige nachhaltige Wertschöpfung fördern.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

2. Der Teilfonds berücksichtigte verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Grundsätzen des Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC) und den Leitsätzen für multinationale Unternehmen der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für Unternehmen. Wurden potenzielle Verstöße gegen die Prinzipien des UNGC festgestellt, wurden die Emittenten einer eigenen Due-Diligence-Prüfung hinsichtlich ESG-Themen unterzogen, um festzustellen, ob sie für die Aufnahme in das Portfolio des Teilfonds geeignet sind, und sie auszuschließen, falls sie als ungeeignet erachtet wurden.
3. Der Teilfonds schloss als umweltschädlich eingestufte Geschäftsaktivitäten aus, wie Kraftwerkskohle und Energieerzeugung aus Kohle.
4. Der Teilfonds berücksichtigte aktiv ökologische und soziale Aspekte, indem er über unsere Engagement- und Stewardship-Teams Mitwirkung bei Emittenten umsetzte, wo HSBC Asset Management dies für angemessen hielt.
5. Der Teilfonds schloss nach entsprechender Analyse Anlagen in umstrittenen Waffen aus.

Der ESG-Score stammt vom externen ESG-Datenanbieter MSCI. Die Berücksichtigung einzelner (in der nachstehenden Tabelle nummerierter) wichtigster nachteiliger Auswirkungen (PAI) drückt sich darin aus, dass der Teilfonds niedrigere Werte als der Referenzwert aufweist. Die bei der Berechnung der PAI-Werte verwendeten Daten stammen von externen Datenanbietern. Sie können auf Unternehmensangaben basieren oder von den Datenanbietern geschätzt werden, wo keine solchen Angaben vorliegen. Bitte beachten Sie, dass es nicht immer möglich ist, die Richtigkeit, Aktualität oder Vollständigkeit der von Drittanbietern bereitgestellten Daten zu garantieren.

Der Teilfonds wurde aktiv verwaltet und bildete keinen Referenzwert nach. Der Referenzwert dient zum Vergleich des Teilfonds mit dem allgemeinen Markt, nicht jedoch der Erreichung der vom Teilfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale. Das Abschneiden der Nachhaltigkeitsindikatoren, die der Teilfonds zur Messung der Erreichung der von ihm beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet, ist in der folgenden Tabelle dargestellt.

Alle Emittenten haben eine gute Unternehmensführung bewiesen, was sich am PAI-Score 10 unten ablesen lässt.

### ● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

| <b>Indikator</b>   | <b>Teilfonds</b> | <b>Referenzwert</b> |
|--|------------------|---------------------|
| ESG-Score  | 5,43             | 4,38                |
| E-Säule  | 5,75             | 5,01                |
| S-Säule  | 6,35             | 5,89                |
| G-Säule  | 6,17             | 5,40                |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente pro Million Euro Umsatz   | 5,12             | 80,81               |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 0,00 %           | 6,09 %              |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 0,00 %           | 0,00 %              |
| 15. THG-Emissionsintensität - Kennzahl in Kilotonnen pro BIP-Einheit (in Millionen Euro)   | 370,98           | 392,62              |

Die Daten in diesem regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung beziehen sich auf den Stand vom 31. März 2024, basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des am 31. März 2024 endenden Geschäftsjahres.

Referenzwert - JP Morgan EMBI Global Diversified

### **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

| <b>Indikator</b>   | <b>Zeitraum zum</b> | <b>Teilfonds</b> | <b>Referenzwert</b> |
|--|---------------------|------------------|---------------------|
| ESG-Score  | 31. März 2024       | 5,43             | 4,38                |
|  | 31. März 2023       | 5,47             | 4,00                |
| E-Säule  | 31. März 2024       | 5,75             | 5,01                |
|  | 31. März 2023       | 5,65             | 4,82                |
| S-Säule  | 31. März 2024       | 6,35             | 5,89                |
|  | 31. März 2023       | 6,11             | 5,12                |
| G-Säule  | 31. März 2024       | 6,17             | 5,40                |
|  | 31. März 2023       | 5,69             | 4,56                |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente pro Million Euro Umsatz   | 31. März 2024       | 5,12             | 80,81               |
|  | 31. März 2023       | 15,10            | 598,59              |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 31. März 2024       | 0,00 %           | 6,09 %              |
|  | 31. März 2023       | 0,00 %           | 5,66 %              |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 31. März 2024       | 0,00 %           | 0,00 %              |
|  | 31. März 2023       | 0,00 %           | 0,00 %              |
| 15. THG-Emissionsintensität - Kennzahl in Kilotonnen pro BIP-Einheit (in Millionen Euro)   | 31. März 2024       | 370,98           | 392,62              |
|  | 31. März 2023       | 304,05           | 370,30              |

Da es sich erst um den zweiten regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung handelt, ist kein Vergleich mit vorangegangenen Zeiträumen möglich.

### **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die vom Teilfonds getätigten nachhaltigen Investitionen trugen unter anderem zu folgenden ökologischen Zielen bei:

1. Reduzierung von Treibhausgasemissionen und Verringerung des CO<sub>2</sub>-Fußabdrucks;
2. Übergang zu oder die Nutzung von erneuerbarer Energie.

Der Teilfonds identifizierte und analysierte ESG-Referenzen eines Unternehmens als wesentlichen Bestandteil des Anlageentscheidungsprozesses für die Portfoliokonstruktion mit dem Ziel, Nachhaltigkeitsrisiken zu reduzieren und Renditen zu steigern. Der Anlageberater zielt darauf ab, durch Berücksichtigung der ESG-Referenzen potenzieller Investitionen einen besseren ESG-Score zu erzielen als der Referenzwert.

### **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Wir bestätigen, dass wir nachhaltige Vermögenswerte darauf geprüft haben, ob sie erhebliche Beeinträchtigungen verursachen können. Dies erfolgte im Rahmen des Standard-Anlageprozesses von HSBC Asset Management (HSBC) und unter Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen.

*Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?*

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 Anlageberater hat alle durch die Offenlegungsverordnung definierten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI) auf ihre Relevanz für den Teilfonds geprüft. Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren legt fest, wie HSBC die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen identifiziert und darauf reagiert, und in welcher Form HSBC Nachhaltigkeitsrisiken berücksichtigt, die sich negativ auf Wertpapiere auswirken können, in die der Teilfonds investiert. HSBC identifizierte in Zusammenarbeit mit externen Screening-Dienstleistern, wie Sustainalytics, ISS, MSCI und Trucost, Unternehmen und Regierungen mit schlechter Bilanz beim Management von ESG-Risiken, und wo solche wesentlichen Risiken identifiziert wurden, führte HSBC zusätzliche ESG-Due-Diligence-Prüfungen durch. Durch Screening identifizierte Nachhaltigkeitsauswirkungen einschließlich der PAI bildeten einen Schlüsselfaktor beim Anlageentscheidungsprozess.

Der oben beschriebene Ansatz führte dazu, dass unter anderem folgende Faktoren geprüft wurden:

- Engagement der Unternehmen für den Übergang zu CO2-armen Wirtschaften, zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern, Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus großen Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails; und
- Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit folgenden Bereichen: demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.

Die spezifischen PAI für diesen Teilfonds waren wie unten beschrieben.

Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren ist auf der Website [www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies](http://www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies) verfügbar.

*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:*

HSBC hat sich der Anwendung und Förderung globaler Standards verpflichtet. Die wichtigsten Schwerpunktbereiche der Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren entsprachen den zehn UNGC-Grundsätzen. Diese Grundsätze stehen in Zusammenhang mit nicht finanziellen Risiken in den Bereichen Menschenrechte, Arbeit, Umweltschutz und Korruptionsbekämpfung. HSBC gehört darüber hinaus zu den Unterzeichnern der UN Principles for Responsible Investment. Diese bildeten den Rahmen für Ermittlung und Management von Nachhaltigkeitsrisiken beim Investmentansatz von HSBC.

Von Unternehmen, in die der Teilfonds investierte, wurde erwartet, dass sie die Anforderungen des UNGC und der damit verbundenen Standards erfüllen. Unternehmen, die belegbar gegen einen der zehn Grundsätze des UNGC

verstießen, wurden systematisch ausgeschlossen. Der Teilfonds führte verstärkte Due-Diligence-Prüfungen bei Unternehmen durch, die als nicht konform mit den Prinzipien des UNGC angesehen wurden oder die nach den unternehmenseigenen ESG Ratings von HSBC als risikoreich angesehen wurden. Darüber hinaus wurden die Unternehmen nach internationalen Standards wie den OECD-Leitsätzen bewertet.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen. Hierbei gelten spezifische von der Union definierte Kriterien.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*



### **Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Weitere vom Teilfonds berücksichtigte wichtigste nachteilige Auswirkungen sind:

- Treibhausgasintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1 und Scope 2)
- Verstöße gegen die UNGC- und OECD-Grundsätze
- Anteil der Investitionen mit Beteiligung an umstrittenen Waffen

Der Ansatz zur Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen beinhaltete unter anderem, dass HSBC das Engagement der Unternehmen für den Übergang zu kohlenstoffarmem Wirtschaften, die zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern sowie die Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette prüfte, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails. Ebenfalls berücksichtigt wurde das Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit den Bereichen demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.

Das Screening führte dazu, dass HSBC nicht in bestimmte Unternehmen und Emittenten investierte.



## Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** Investitionen entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden: basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des Bezugszeitraums zum 31.03.2024

| Größte Investitionen                              | Sektor         | % der Vermögenswerte | Land                  |
|---|----------------|----------------------|-----------------------|
| Government Of Mexico 7,5 %<br>03.06.2027          | Staatsanleihen | 4,29 %               | Mexiko                |
| Government Of Colombia 7,0 %<br>26.03.2031        | Staatsanleihen | 4,24 %               | Kolumbien             |
| Government Of Thailand 1,585 %<br>17.12.2035      | Staatsanleihen | 3,35 %               | Thailand              |
| Government Of Brazil 10,0 %<br>01.01.2029         | Staatsanleihen | 3,07 %               | Brasilien             |
| Government Of South Africa 9,0 %<br>31.01.2040    | Staatsanleihen | 2,70 %               | Südafrika             |
| Government Of Mexico 8,5 %<br>18.11.2038          | Staatsanleihen | 2,63 %               | Mexiko                |
| Government Of Romania 5,8 %<br>26.07.2027         | Staatsanleihen | 2,63 %               | Rumänien              |
| Government Of Brazil 10,0 %<br>01.01.2033         | Staatsanleihen | 2,59 %               | Brasilien             |
| Government Of Poland 0,25 %<br>25.10.2026         | Staatsanleihen | 2,51 %               | Polen                 |
| Government Of Poland 1,75 %<br>25.04.2032         | Staatsanleihen | 2,27 %               | Polen                 |
| Government Of Czech Republic<br>1,75 % 23.06.2032 | Staatsanleihen | 2,03 %               | Tschechische Republik |
| Government Of Hungary 4,5 %<br>27.05.2032         | Staatsanleihen | 2,02 %               | Ungarn                |
| Government Of Malaysia 4,254 %<br>31.05.2035      | Staatsanleihen | 1,92 %               | Malaysia              |
| Government Of Indonesia 7,5 %<br>15.06.2035       | Staatsanleihen | 1,91 %               | Indonesien            |
| Kfw 0,625 % 25.07.2025                            | Staatsanleihen | 1,84 %               | Deutschland           |

Barmittel und Derivate wurden nicht berücksichtigt



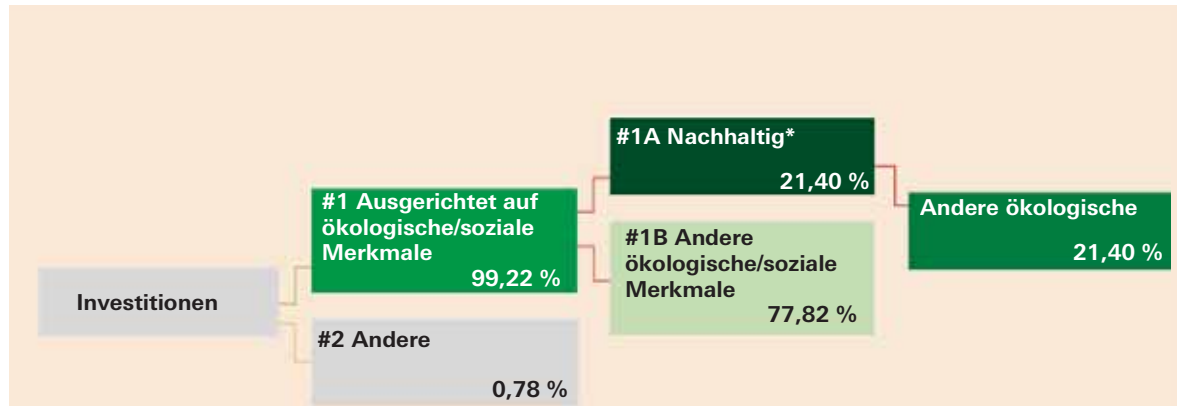


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

21,40 % des Portfolios waren in nachhaltige Vermögenswerte investiert.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?



**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**#2 Andere Investitionen** umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:  
- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.  
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

### In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

| Sektor / Teilsektor    | % der Vermögenswerte |
|------------------------|----------------------|
| Staatsanleihen         | 99,49 %              |
| Barmittel und Derivate | 0,46 %               |
| Andere                 | 0,05 %               |
| Finanzen               | 0,00 %               |
| Summe                  | 100,00 %             |

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.



### Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

Der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen ist in den obigen Feldern zur Vermögensallokation ersichtlich.

### Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

Ja:

In fossiles Gas     In Kernenergie

Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

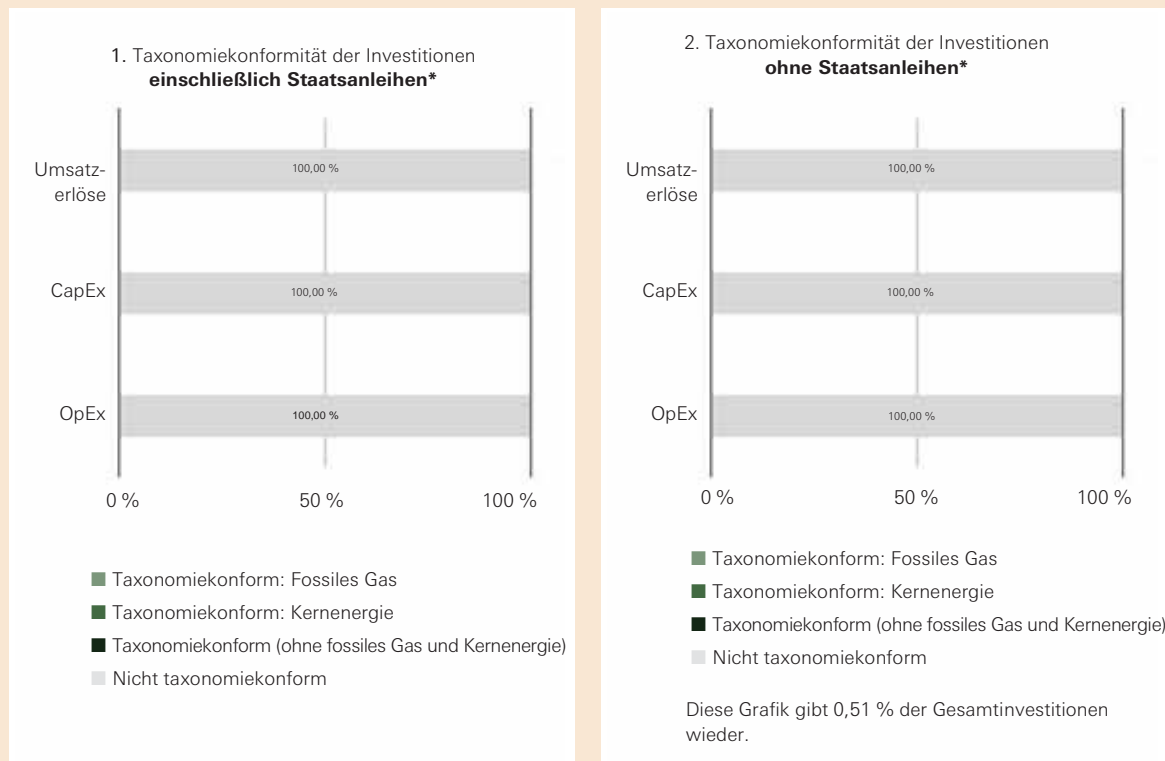
- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen.

- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

**Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

**Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.**



\* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

**Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Im Referenzzeitraum betrug der Anteil der Investitionen des Fonds, die in Übergangstätigkeiten geflossen sind, 0,00 % und der Anteil der Investitionen, die in ermöglichende Tätigkeiten geflossen ist, 0,00 %.

**Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

| Indikator   | 2023-2024 | 2022-2023 |
|---|-----------|-----------|
| Umsatz – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                       | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform: Kernenergie                        | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie) | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Nicht taxonomiekonform                               | 100,00 %  | 100,00 %  |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                        | n. z.     | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                         | n. z.     | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)  | n. z.     | 0,00 %    |
| CAPEX – Nicht taxonomiekonform                                | 100,00 %  | 100,00 %  |
| OPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                         | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                          | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)   | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Nicht taxonomiekonform                                 | 100,00 %  | 100,00 %  |

Da es sich erst um den zweiten Berichtszeitraum des Teilfonds handelt, ist ein Vergleich mit der Zeit davor nicht erforderlich.



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?**

Der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel war 21,40 %. Der Teilfonds hat sich nicht verpflichtet, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen.



### **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Teilfonds investierte nicht in sozial nachhaltige Anlagen.



### **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

#2 Andere Investitionen umfasst die Finanzinstrumente, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden. In manchen Fällen ist dies auf die Nichtverfügbarkeit von Daten und Unternehmensmaßnahmen zurückzuführen. Diese Positionen unterlagen nach wie vor dem vollständigen Ausschluss-Screening von HSBC und wurden im Hinblick auf verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Prinzipien des UNGC und der OECD geprüft.

Der Teilfonds hielt Barmittel / Barmitteläquivalente (der Prozentsatz der gehaltenen Barmittel ist in der obigen Tabelle der Sektoren/Teilsektoren unter der Überschrift „In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?“ ersichtlich) zum Zwecke des Liquiditätsmanagements sowie derivative Finanzinstrumente zum Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements. Barmittel / Barmitteläquivalente und derivative Finanzinstrumente verfügen aufgrund der Art dieser Instrumente über keinen ökologischen oder sozialen Mindestschutz.



### **Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?**

Im Laufe des Berichtszeitraums schloss der Anlageberater unter anderem verbotene Waffen, umstrittene Waffen, Unternehmen, die mehr als 10 % ihres Umsatzes aus Kraftwerkskohle und Energieerzeugung aus Kohle generieren, und Tabakherstellung aus und investierte in Unternehmen mit verantwortungsvollen Geschäftspraktiken gemäß den Prinzipien des UNGC.

Nach der Identifizierung des zulässigen Anlageuniversums konstruierte der Anlageberater ein Portfolio, dessen CO<sub>2</sub>-Intensität (berechnet als gewichteter Durchschnitt der CO<sub>2</sub>-Intensitäten der Anlagen des Teilfonds) niedriger ist als der gewichtete Durchschnitt der Bestandteile des Referenzwerts. Dies führte zu einem PAI-Score, der unter dem Referenzwert lag. Der Teilfonds bewertete auch ESG-Scores mit dem Ergebnis, dass der ESG-Score während des gesamten Berichtszeitraums über dem des Referenzwerts lag.

Darüber hinaus wurden alle Positionen auf Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der OECD untersucht, um Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung innerhalb des Portfolios sicherzustellen.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Nicht zutreffend.

- **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?**

Nicht zutreffend.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Name des Produkts: HSBC GLOBAL INVESTMENT FUNDS - GLOBAL ESG CORPORATE BOND

Unternehmenskennung (LEI-Code): 213800GRNWXQGN3QZK39

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen 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?

| <input checked="" type="checkbox"/> <input checked="" type="checkbox"/> <input type="checkbox"/> <b>Ja</b>   | <input checked="" type="checkbox"/> <input type="checkbox"/> <input checked="" type="checkbox"/> <b>Nein</b>  |
|--|---|
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel</b> getätigt: _ %<br><br><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><br><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit <b>ökologische/soziale Merkmale beworben</b> und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 27,06 % an nachhaltigen Investitionen<br><br><input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><br><input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><br><input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel |
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel</b> getätigt: _ %  | <input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine <b>nachhaltigen Investitionen getätigt</b>   |



### Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Während des Geschäftsjahres zum 31. März 2024 (der Bezugszeitraum) bewarb der Teilfonds die folgenden Merkmale:

- Der Teilfonds investierte in Wertpapiere, die Klimaschutz- oder umweltschutzbezogene Projekte unterstützten.
- Der Teilfonds berücksichtigte verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Grundsätzen des Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC) und den Leitsätzen für multinationale Unternehmen der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für Unternehmen. Wurden potenzielle Verstöße

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

gegen die Prinzipien des UNGC festgestellt, wurden die Emittenten einer eigenen Due-Diligence-Prüfung hinsichtlich ESG-Themen unterzogen, um festzustellen, ob sie für die Aufnahme in das Portfolio des Teilfonds geeignet sind, und sie auszuschließen, falls sie als ungeeignet erachtet wurden.

3. Der Teilfonds schloss Geschäftstätigkeiten aus, die als umweltschädlich gelten, wie z. B. die Förderung von Kraftwerkskohle und die Kohleverstromung.
4. Der Teilfonds prüfte und analysierte alle Unternehmen oder Emittenten im Hinblick auf ökologische Merkmale, insbesondere physische Risiken durch den Klimawandel und Personalmanagement.
5. Der Teilfonds berücksichtigte aktiv ökologische und soziale Aspekte, indem er über unsere Engagement- und Stewardship-Teams Mitwirkung bei Emittenten umsetzte, wo HSBC Asset Management dies für angemessen hielt.
6. Der Teilfonds schloss nach entsprechender Analyse Anlagen in umstrittenen Waffen aus.

Die auf ESG und Nachhaltigkeitsindikatoren bezogenen Scores werden anhand der proprietären Methodik von HSBC Asset Management und externer ESG-Datenanbieter berechnet. Wir verwenden ESG-Scores von Drittanbietern (z. B. ESG-Scores von MSCI) und haben auch eigene Scores entwickelt, um unsere eigene Sicht der ESG-Risiken und -Chancen widerzuspiegeln. Wir haben eine maßgeschneiderte Branchensegmentierung entwickelt (abgeleitet vom MSCI Global Industry Classification Standard), bei der wir die Wesentlichkeit der wichtigsten E-, S- und G-Faktoren von MSCI auf einer sektoralen Basis neu bewerten und eine sektorspezifische HSBC-ESG-Gewichtung erstellen.

Die Berücksichtigung einzelner wichtigster nachteiliger Auswirkungen (PAI) wird in der nachstehenden Tabelle anhand ihrer Nummerierung im Vergleich zum Referenzwert angegeben. Die bei der Berechnung der PAI-Werte verwendeten Daten stammen von externen Datenanbietern. Sie können auf Unternehmens-/Emittentenangaben basieren oder von den Datenanbietern geschätzt werden wo keine solchen Angaben vorliegen. Bitte beachten Sie, dass es nicht immer möglich ist, die Richtigkeit, Aktualität oder Vollständigkeit der von Drittanbietern bereitgestellten Daten zu garantieren. Der Referenzwert wurde für den Marktvergleich herangezogen, diente aber nicht der Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale des Teilfonds.

Das Abschneiden der Nachhaltigkeitsindikatoren, die der Teilfonds zur Messung der Erreichung der von ihm beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet, ist in der folgenden Tabelle dargestellt. Es wurde auf das Erreichen eines ESG-Score des Teilfonds hingearbeitet, der über dem vom Teilfonds ausgewählten Referenzindex liegt (ein höherer Score als der Referenzwert bedeutet bessere ESG-Referenzen).

Alle Unternehmen/Emittenten haben eine gute Unternehmensführung bewiesen, was sich am PAI-Score 10 unten ablesen lässt.

### **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

| <b>Indikator</b>   | <b>Teilfonds</b> | <b>Referenzwert</b> |
|--|------------------|---------------------|
| ESG-Score  | 7,72             | 7,20                |
| E-Säule  | 7,85             | 7,52                |
| S-Säule  | 5,38             | 5,09                |
| G-Säule  | 6,21             | 5,85                |
| 1. THG-Emissionen – Tonnen CO2-Äquivalente   | 3.377,35         | 499.257,46          |
| 2. CO2-Fußabdruck – Tonnen CO2 pro Million Euro (EVIC)   | 22,59            | 59,10               |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO2-Äquivalente pro Million Euro Umsatz  | 62,29            | 97,25               |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 0,00 %           | 0,28 %              |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen,  | 0,00 %           | 0,00 %              |

Die Daten in diesem regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung beziehen sich auf den Stand vom 31. März 2024, basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des am 31. März 2024 endenden Geschäftsjahres.

Referenzwert – Bloomberg Global Aggregate Corporates Diversified

### **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

| <b>Indikator</b>   | <b>Zeitraum zum</b> | <b>Teilfonds</b> | <b>Referenzwert</b> |
|--|---------------------|------------------|---------------------|
| ESG-Score  | 31. März 2024       | 7,72             | 7,20                |
|  | 31. März 2023       | 7,80             | 0,00                |
| E-Säule  | 31. März 2024       | 7,85             | 7,52                |
|  | 31. März 2023       | 7,86             | 0,00                |
| S-Säule  | 31. März 2024       | 5,38             | 5,09                |
|  | 31. März 2023       | 5,39             | 0,00                |
| G-Säule  | 31. März 2024       | 6,21             | 5,85                |
|  | 31. März 2023       | 6,08             | 0,00                |
| 1. THG-Emissionen – Tonnen CO2-Äquivalente   | 31. März 2024       | 3.377,35         | 499.257,46          |
|  | 31. März 2023       | 4.374,97         | 618.146,33          |
| 2. CO2-Fußabdruck – Tonnen CO2 pro Million Euro (EVIC)   | 31. März 2024       | 22,59            | 59,10               |
|  | 31. März 2023       | 26,40            | 61,93               |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO2-Äquivalente pro Million Euro Umsatz  | 31. März 2024       | 62,29            | 97,25               |
|  | 31. März 2023       | 75,72            | 185,66              |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 31. März 2024       | 0,00 %           | 0,28 %              |
|  | 31. März 2023       | 0,00 %           | 1,86 %              |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 31. März 2024       | 0,00 %           | 0,00 %              |
|  | 31. März 2023       | 0,00 %           | 0,00 %              |

Da es sich erst um den zweiten regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung handelt, ist kein Vergleich mit vorangegangenen Zeiträumen möglich.

### **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die vom Teilfonds getätigten nachhaltigen Investitionen trugen unter anderem zu folgenden ökologischen Zielen bei:

1. Reduzierung von Treibhausgasemissionen und Verringerung des CO2-Fußabdrucks;
2. Übergang zu oder die Nutzung von erneuerbarer Energie.

Der Teilfonds identifizierte und analysierte ESG-Referenzen eines Unternehmens als wesentlichen Bestandteil des Anlageentscheidungsprozesses für die Portfoliokonstruktion mit dem Ziel, Nachhaltigkeitsrisiken zu reduzieren und Renditen zu steigern. Der Anlageberater zielt darauf ab, durch Berücksichtigung der ESG-Referenzen potenzieller Investitionen einen besseren ESG-Score zu erzielen als der Referenzwert.

***Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?***

Wir bestätigen, dass wir nachhaltige Vermögenswerte darauf geprüft haben, ob sie erhebliche Beeinträchtigungen verursachen können. Dies erfolgte im Rahmen des Standard-Anlageprozesses von HSBC Asset Management (HSBC) und unter Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen.

*Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?*

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 Anlageberater hat alle durch die Offenlegungsverordnung definierten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI) auf ihre Relevanz für den Teilfonds geprüft. Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren legt fest, wie HSBC die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen identifiziert und darauf reagiert, und in welcher Form HSBC Nachhaltigkeitsrisiken berücksichtigt, die sich negativ auf Wertpapiere auswirken können, in die der Teilfonds investiert. HSBC identifizierte in Zusammenarbeit mit externen Screening-Dienstleistern wie Sustainalytics, ISS, MSCI und Trucost Unternehmen und Staaten mit schlechter Bilanz beim Management von ESG-Risiken, und wo solche wesentlichen Risiken identifiziert wurden, führte HSBC zusätzliche Due Diligence-Prüfungen durch. Durch Screening identifizierte Nachhaltigkeitsauswirkungen, einschließlich der relevanten PAI, bildeten einen Schlüsselfaktor beim Anlageentscheidungsprozess.

Der oben beschriebene Ansatz führte dazu, dass unter anderem folgende Faktoren geprüft wurden:

- Engagement der Unternehmen für den Übergang zu CO2-armen Wirtschaften, zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern, Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus großen Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails; und
- Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit folgenden Bereichen: demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.

Die spezifischen PAI für diesen Teilfonds waren wie unten beschrieben.

Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsvolles Investieren ist auf der Website verfügbar unter: [www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies](http://www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies).

*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:*

HSBC hat sich der Anwendung und Förderung globaler Standards verpflichtet. Die wichtigsten Schwerpunktbereiche der Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren entsprachen den zehn UNGC-Grundsätzen. Diese Grundsätze stehen in Zusammenhang mit nicht finanziellen Risiken in den



Bereichen Menschenrechte, Arbeit, Umweltschutz und Korruptionsbekämpfung. HSBC gehört darüber hinaus zu den Unterzeichnern der UN Principles for Responsible Investment. Diese bildeten den Rahmen für Ermittlung und Management von Nachhaltigkeitsrisiken beim Investmentansatz von HSBC. Von Unternehmen, in die der Teilfonds investierte, wurde erwartet, dass sie die Anforderungen des UNGC und der damit verbundenen Standards erfüllen. Unternehmen, die belegbar gegen einen der zehn Grundsätze des UNGC verstießen, wurden systematisch ausgeschlossen. Der Teilfonds führte verstärkte Due-Diligence-Prüfungen bei Unternehmen durch, die als nicht konform mit den Prinzipien des UNGC angesehen wurden oder die nach den unternehmenseigenen ESG Ratings von HSBC als risikoreich angesehen wurden. Darüber hinaus wurden die Unternehmen nach internationalen Standards wie den OECD-Leitsätzen bewertet.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen. Hierbei gelten spezifische von der Union definierte Kriterien.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*



### **Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Die vom Teilfonds berücksichtigte wichtigste nachteilige Auswirkungen waren:

- Treibhausgasemissionen (Scope 1 und Scope 2)
- CO<sub>2</sub>-Fußabdruck (Scope 1 und Scope 2)
- Treibhausgasintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1 und Scope 2)
- Verstöße gegen die Prinzipien des UNGC und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD)
- Anteil der Investitionen mit Beteiligung an umstrittenen Waffen

Der Ansatz zur Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen beinhaltete unter anderem, dass HSBC das Engagement der Unternehmen für den Übergang zu kohlenstoffarmem Wirtschaften, die zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern sowie die Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette prüfte, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails. Ebenfalls berücksichtigt wurde das Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit den Bereichen demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.

Das Screening führte dazu, dass HSBC nicht in bestimmte Unternehmen und Emittenten investierte.



## Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der Investitionen** entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden: basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des Bezugszeitraums zum 31.03.2024

| Größte Investitionen   | Sektor                  | % der Vermögenswerte | Land  |
|--|-------------------------|----------------------|---|
| HSBC OIEC CORP BOND AC<br>11032573                               | Finanzen                | 9,95 %               | Vereinigtes Königreich von Großbritannien und Nordirland. |
| Bnp Paribas S.a. 5,125 %<br>13.01.2029                           | Finanzen                | 1,14 %               | Frankreich  |
| Government Of France 4,25 %<br>25.10.2023                        | Staatsanleihen          | 1,05 %               | Frankreich  |
| Government Of The United States<br>Of America 3,625 % 15.02.2053 | Staatsanleihen          | 0,93 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| Standard Chartered Plc Frn<br>30.03.2026                         | Finanzen                | 0,77 %               | Vereinigtes Königreich von Großbritannien und Nordirland. |
| Schneider Electric Se 3,375 %<br>06.04.2025                      | Industriegüter          | 0,75 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| Government Of France 1,75 %<br>25.11.2024                        | Staatsanleihen          | 0,70 %               | Frankreich  |
| Credit Suisse Ag, New York Branch<br>Frn 21.02.2025              | Andere                  | 0,65 %               | Schweiz   |
| Discover Financial Services 6,7 %<br>29.11.2032                  | Finanzen                | 0,59 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| Astrazeneca Finance Llc 4,9 %<br>03.03.2030                      | Gesundheitswesen        | 0,58 %               | Vereinigtes Königreich von Großbritannien und Nordirland. |
| Credit Agricole S.a. 5,301 %<br>12.07.2028                       | Finanzen                | 0,58 %               | Frankreich  |
| Dominion Energy, Inc. 5,375 %<br>15.11.2032                      | Versorger               | 0,58 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| Nutrien Ltd. 5,95 % 07.11.2025                                   | Grundstoffe             | 0,58 %               | Kanada  |
| Toronto-dominion Bank 5,156 %<br>10.01.2028                      | Finanzen                | 0,58 %               | Kanada  |
| Texas Instruments Incorporated<br>4,6 % 15.02.2028               | Informationstechnologie | 0,57 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |

Barmittel und Derivate wurden nicht berücksichtigt

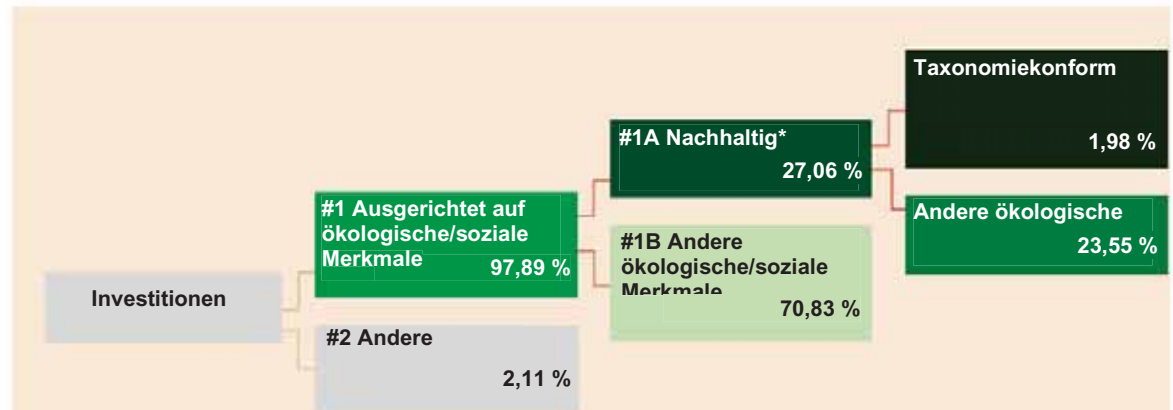


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

27,06 % des Portfolios waren in nachhaltige Vermögenswerte investiert.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

### ● *Wie sah die Vermögensallokation aus?*



**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**#2 Andere Investitionen** umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

\* Ein Unternehmen oder Emittent, das bzw. der als nachhaltige Investition angesehen wird, kann sowohl zu einem sozialen als auch zu einem ökologischen Ziel beitragen, das an der EU-Taxonomie ausgerichtet sein kann oder nicht. Die Zahlen in der obigen Grafik berücksichtigen dies. Jedoch darf eine Gesellschaft oder ein Emittent unter dem Punkt der nachhaltigen Investitionen (#1A Nachhaltige Investitionen) nur einmal erfasst werden.

Die Prozentzahlen von taxonomiekonformen Investitionen und Andere ökologische Merkmale stimmen aufgrund der unterschiedlichen Berechnungsmethoden für nachhaltige Investitionen und taxonomiekonforme Investitionen nicht mit #1A Nachhaltige Investitionen überein.

## ● In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

| Sektor / Teilsektor                              | % der Vermögenswerte |
|--|----------------------|
| Finanzen   | 40,45 %              |
| Andere   | 16,30 %              |
| Staatsanleihen                                   | 7,11 %               |
| Kommunikationsdienstleistungen                   | 5,09 %               |
| Industriegüter                                   | 4,79 %               |
| Gesundheitswesen                                 | 4,52 %               |
| Basiskonsumgüter                                 | 4,50 %               |
| Versorger  | 3,86 %               |
| .....  | .....                |
| <i>Stromversorgungsbetriebe</i>                  | 1,98 %               |
| .....  | .....                |
| <i>Erdgas</i>                                    | 0,11 %               |
| .....  | .....                |
| <i>Multi-Versorger</i>                           | 1,78 %               |
| .....  | .....                |
| Immobilien                                       | 3,27 %               |
| Informationstechnologie                          | 3,18 %               |
| Zyklische Konsumgüter                            | 3,00 %               |
| Grundstoffe                                      | 1,92 %               |
| Energie  | 1,70 %               |
| .....  | .....                |
| <i>Integrierter Öl- und Gaskonzern</i>           | 0,87 %               |
| .....  | .....                |
| <i>Exploration und Produktion von Öl und Gas</i> | 0,29 %               |
| .....  | .....                |
| <i>Lagerung und Transport von Öl und Gas</i>     | 0,54 %               |
| .....  | .....                |
| Barmittel und Derivate                           | 0,29 %               |
| Summe  | 100,00 %             |

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.



## ● Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

Der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen ist in den obigen Feldern zur Vermögensallokation ersichtlich.

### ● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

Ja:
   
      In fossiles Gas       In Kernenergie
   
 Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

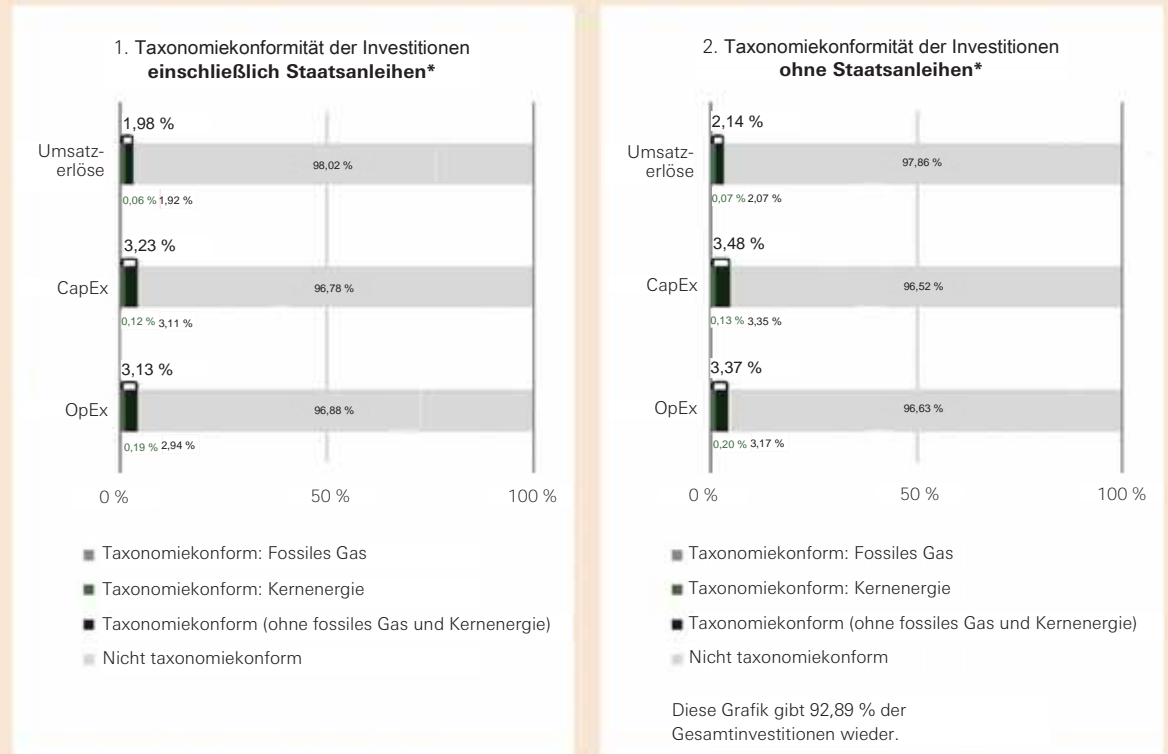
Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

**Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

**Ermöglichte Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

**Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.**



\* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

**Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Im Referenzzeitraum betrug der Anteil der Investitionen des Fonds, die in Übergangstätigkeiten geflossen sind, 0,06 % und der Anteil der Investitionen, die in ermöglichende Tätigkeiten geflossen ist, 1,67 %.

**Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

| Indikator   | 2023-2024 | 2022-2023 |
|---|-----------|-----------|
| Umsatz – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                       | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform: Kernenergie                        | 0,06 %    | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie) | 1,92 %    | 0,00 %    |
| Umsatz – Nicht taxonomiekonform                               | 98,02 %   | 100,00 %  |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                        | n. z.     | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                         | 0,12 %    | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)  | 3,11 %    | 0,00 %    |
| CAPEX – Nicht taxonomiekonform                                | 96,78 %   | 100,00 %  |
| OPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                         | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                          | 0,19 %    | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)   | 2,94 %    | 0,00 %    |
| OPEX – Nicht taxonomiekonform                                 | 96,88 %   | 100,00 %  |

Da es sich erst um den zweiten Berichtszeitraum des Teilfonds handelt, ist ein Vergleich mit der Zeit davor nicht erforderlich.



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?**

Der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel war 23,55 %. Aufgrund der mangelnden Abdeckung und der fehlenden Daten hat sich der Teilfonds nicht verpflichtet, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen.



## **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Teilfonds investierte nicht in sozial nachhaltige Anlagen.



## **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

#2 Andere Investitionen umfasst die Finanzinstrumente, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden. In manchen Fällen ist dies auf die Nichtverfügbarkeit von Daten und Unternehmensmaßnahmen zurückzuführen. Diese Positionen unterlagen nach wie vor dem vollständigen Ausschluss-Screening von HSBC und wurden im Hinblick auf verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Prinzipien des UNGC und der OECD geprüft.

Der Teilfonds hielt Barmittel / Barmitteläquivalente (der Prozentsatz der gehaltenen Barmittel ist in der obigen Tabelle der Sektoren/Teilspektoren unter der Überschrift „In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?“ ersichtlich) zum Zwecke des Liquiditätsmanagements sowie derivative Finanzinstrumente zum Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements. Barmittel / Barmitteläquivalente und derivative Finanzinstrumente verfügen aufgrund der Art dieser Instrumente über keinen ökologischen oder sozialen Mindestschutz.



## **Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?**

Der Teilfonds strebte einen langfristigen Gesamtertrag an, indem er in ein Portfolio aus Unternehmensanleihen investierte, und war bestrebt, ein höheres ESG-Rating (Umwelt, Soziales, Unternehmensführung) und eine geringere CO<sub>2</sub>-Intensität als sein Referenzwert, der Bloomberg Global Aggregate Corporates Diversified Hedged USD (der „Referenzwert“), zu erreichen, wobei er ESG-Merkmale im Sinne von Artikel 8 der Offenlegungsverordnung bewarb.

Der Teilfonds hat in festverzinsliche Wertpapiere mit Investment-Grade-Rating und ähnliche Wertpapiere investiert, die von Unternehmen ausgegeben werden, die bestimmte Kriterien hinsichtlich des ESG-Ratings und einer geringeren CO<sub>2</sub>-Intensität erfüllen („Kriterien hinsichtlich ESG und einer geringeren CO<sub>2</sub>-Intensität“). Der Teilfonds investierte in entwickelte Märkte. Anlagen lauteten hauptsächlich auf Schwellenmarktwährungen. Der Teilfonds konnte auch in Schwellenmarktanleihen sowie forderungsbesicherte Wertpapiere („ABS“) und hypothekenbesicherte Wertpapiere („MBS“) investieren.

Die nachfolgend erläuterten Kriterien hinsichtlich ESG und einer geringeren CO<sub>2</sub>-Intensität werden von HSBC selbst entwickelt, unterliegen kontinuierlichem Research und haben sich im Laufe der Zeit möglicherweise geändert, falls neue Kriterien identifiziert wurden.

Nach der Identifizierung des zulässigen Anlageuniversums war der Anlageberater bestrebt, ein Portfolio mit einem höheren ESG-Rating und einer geringeren CO<sub>2</sub>-Intensität (berechnet

als gewichteter Durchschnitt der ESG-Ratings und CO2-Intensitäten der Anlagen des Teilfonds) gegenüber dem gewichteten Durchschnitt der Bestandteile des Referenzwerts zu konstruieren. Bei der Beurteilung des ESG Ratings und der CO2-Intensität der Emittenten konnte sich der Anlageberater auf Fachwissen, Analysen und Informationen von etablierten Finanzdatenanbietern stützen.

Der Teilfonds wurde aktiv verwaltet und bildete keinen Referenzwert nach. Der Referenzwert wurde für den Marktvergleich des Teilfonds verwendet.



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.

● ***Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?***

Nicht zutreffend.

● ***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?***

Nicht zutreffend.

● ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?***

Nicht zutreffend.

● ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?***

Nicht zutreffend.

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen 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.

Name des Produkts: HSBC GLOBAL INVESTMENT FUNDS - GLOBAL GREEN BOND

Unternehmenskennung (LEI-Code): 213800HHURCXBOG5F376

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

| <input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> <input type="checkbox"/> <b>Ja</b>   | <input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> <b>Nein</b>   |
|--|--|
| <p><input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel</b> getätigt: _ %</p> <p><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</p> <p><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</p> <p><input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel</b> getätigt: _ %</p> | <p><input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit <b>ökologische/soziale Merkmale beworben</b> und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 95,88 % an nachhaltigen Investitionen</p> <p><input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</p> <p><input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</p> <p><input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel</p> <p><input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>ökologische/soziale Merkmale beworben</b>, aber keine <b>nachhaltigen Investitionen getätigt</b></p> |



### Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Während des Geschäftsjahres zum 31. März 2024 (der Bezugszeitraum) bewarb der Teilfonds die folgenden Merkmale:

- Der Teilfonds investierte in Wertpapiere, die Klimaschutz- oder umweltschutzbezogene Projekte unterstützten.
- Der Teilfonds berücksichtigte verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Grundsätzen des Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC) und den Leitsätzen für multinationale Unternehmen der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für Unternehmen. Wurden potenzielle Verstöße gegen die Prinzipien des UNGC festgestellt, wurden die Emittenten einer eigenen Due-Diligence-Prüfung hinsichtlich ESG-Themen unterzogen, um festzustellen, ob sie für die Aufnahme in das Portfolio des Teilfonds geeignet sind, und sie auszuschließen, falls sie als ungeeignet erachtet wurden.
- Der Teilfonds schloss Geschäftstätigkeiten aus, die als umweltschädlich gelten, wie z. B. die Förderung von Kraftwerkskohle und die Kohleverstromung.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.



4. Der Teilfonds prüfte und analysierte alle Unternehmen oder Emittenten im Hinblick auf ökologische Merkmale, insbesondere physische Risiken durch den Klimawandel und Personalmanagement.
5. Der Teilfonds berücksichtigte aktiv ökologische und soziale Aspekte, indem er über unsere Engagement- und Stewardship-Teams Mitwirkung bei Emittenten umsetzte, wo HSBC Asset Management dies für angemessen hielt.
6. Der Teilfonds schloss nach entsprechender Analyse Anlagen in umstrittenen Waffen aus.

Die ESG-Scores stammen von MSCI, einem Drittanbieter von ESG-Daten. Die Berücksichtigung einzelner wichtigster nachteiliger Auswirkungen (PAI) wird in der nachstehenden Tabelle anhand ihrer Nummerierung im Vergleich zum Referenzwert angegeben. Die bei der Berechnung der PAI-Werte verwendeten Daten stammen von externen Datenanbietern. Sie können auf Unternehmens-/Emittentenangaben basieren oder von den Datenanbietern geschätzt werden wo keine solchen Angaben vorliegen. Bitte beachten Sie, dass es nicht immer möglich ist, die Richtigkeit, Aktualität oder Vollständigkeit der von Drittanbietern bereitgestellten Daten zu garantieren.

Der Referenzwert wurde für den Marktvergleich herangezogen, diente aber nicht der Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale des Teilfonds.

Das Abschneiden der Nachhaltigkeitsindikatoren, die der Teilfonds zur Messung der Erreichung der von ihm beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet, ist in der folgenden Tabelle dargestellt. Es wurde auf das Erreichen eines ESG-Score des Teilfonds hingearbeitet, der über dem vom Teilfonds ausgewählten Referenzindex liegt (ein höherer Score als der Referenzwert bedeutet bessere ESG-Referenzen).

Alle Unternehmen/Emittenten haben eine gute Unternehmensführung bewiesen, was sich am PAI-Score 10 unten ablesen lässt.

### **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

| <b>Indikator</b>   | <b>Teilfonds</b> | <b>Referenzwert</b> |
|--|------------------|---------------------|
| ESG-Score  | 7,73             | 7,27                |
| E-Säule  | 7,67             | 6,77                |
| S-Säule  | 6,07             | 6,38                |
| G-Säule  | 6,15             | 6,53                |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente pro Million Euro Umsatz   | 3,40             | 58,92               |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 0,00 %           | 0,00 %              |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 0,79 %           | 0,24 %              |

Die Daten in diesem regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung beziehen sich auf den Stand vom 31. März 2024, basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des am 31. März 2024 endenden Geschäftsjahres.

Referenzwert - Bloomberg Global Green Bond

**... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

| Indikator  | Zeitraum zum  | Teilfonds | Referenzwert |
|--|---------------|-----------|--------------|
| ESG-Score  | 31. März 2024 | 7,73      | 7,27         |
|  | 31. März 2023 | 8,12      | 7,25         |
| E-Säule  | 31. März 2024 | 7,67      | 6,77         |
|  | 31. März 2023 | 7,99      | 6,38         |
| S-Säule  | 31. März 2024 | 6,07      | 6,38         |
|  | 31. März 2023 | 5,88      | 6,28         |
| G-Säule  | 31. März 2024 | 6,15      | 6,53         |
|  | 31. März 2023 | 6,16      | 6,45         |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente pro Million Euro Umsatz   | 31. März 2024 | 3,40      | 58,92        |
|  | 31. März 2023 | 0,00      | 0,00         |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 31. März 2024 | 0,00 %    | 0,00 %       |
|  | 31. März 2023 | 0,00 %    | 0,00 %       |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 31. März 2024 | 0,79 %    | 0,24 %       |
|  | 31. März 2023 | 0,00 %    | 0,00 %       |

Da es sich erst um den zweiten regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung handelt, ist kein Vergleich mit vorangegangenen Zeiträumen möglich.

**Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die vom Teilfonds getätigten nachhaltigen Investitionen trugen unter anderem zu folgenden ökologischen Zielen bei:

1. Reduzierung von Treibhausgasemissionen und Verringerung des CO<sub>2</sub>-Fußabdrucks;
2. Übergang zu oder die Nutzung von erneuerbarer Energie.

Der Fonds bezieht die Identifizierung und Analyse der ESG-Referenzen eines Emittenten als integralen Bestandteil in den Anlageentscheidungsprozess ein, um die Bewertung von Risiken und potenziellen Renditen zu unterstützen.

**Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Wir bestätigen, dass wir nachhaltige Vermögenswerte darauf geprüft haben, ob sie erhebliche Beeinträchtigungen verursachen können. Dies erfolgte im Rahmen des Standard-Anlageprozesses von HSBC Asset Management (HSBC) und unter Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen.

*Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?*

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 Anlageberater hat alle durch die Offenlegungsverordnung definierten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI) auf ihre Relevanz für den Teilfonds geprüft. Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren legt fest, wie HSBC die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen identifiziert und darauf reagiert, und in welcher Form HSBC Nachhaltigkeitsrisiken berücksichtigt, die sich negativ auf Wertpapiere auswirken können, in die der Teilfonds investiert. HSBC identifizierte in Zusammenarbeit mit externen Screening-Dienstleistern wie Sustainalytics, ISS, MSCI und Trucost Unternehmen und Staaten mit schlechter Bilanz beim Management von ESG-Risiken, und wo solche wesentlichen Risiken identifiziert wurden, führte HSBC zusätzliche Due Diligence-Prüfungen durch. Durch Screening identifizierte Nachhaltigkeitsauswirkungen, einschließlich der relevanten PAI, bildeten einen Schlüsselfaktor beim Anlageentscheidungsprozess.

Der oben beschriebene Ansatz führte dazu, dass unter anderem folgende Faktoren geprüft wurden:

- Engagement der Unternehmen für den Übergang zu CO<sub>2</sub>-armen Wirtschaften, zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern, Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus großen Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails; und
- Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit folgenden Bereichen: demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.

Die spezifischen PAI für diesen Teilfonds waren wie unten beschrieben.

Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsvolles Investieren ist auf der Website verfügbar unter:

[www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies](http://www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies).

*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:*

HSBC hat sich der Anwendung und Förderung globaler Standards verpflichtet. Die wichtigsten Schwerpunktbereiche der Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren entsprachen den zehn UNGC-Grundsätzen. Diese Grundsätze stehen in Zusammenhang mit nicht finanziellen Risiken in den Bereichen Menschenrechte, Arbeit, Umweltschutz und Korruptionsbekämpfung. HSBC gehört darüber hinaus zu den Unterzeichnern der UN Principles for Responsible Investment. Diese bildeten den Rahmen für Ermittlung und Management von Nachhaltigkeitsrisiken beim Investmentansatz von HSBC. Von Unternehmen, in die der Teilfonds investierte, wurde erwartet, dass sie die Anforderungen des UNGC und der damit verbundenen Standards erfüllen. Unternehmen, die belegbar gegen einen der zehn Grundsätze des UNGC verstießen, wurden systematisch ausgeschlossen. Der Teilfonds führte verstärkte Due-Diligence-Prüfungen bei Unternehmen durch, die als nicht konform mit den Prinzipien des UNGC angesehen wurden oder die nach den unternehmenseigenen ESG Ratings von HSBC als risikoreich angesehen wurden. Darüber hinaus wurden die Unternehmen nach internationalen Standards wie den OECD-Leitsätzen bewertet.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen. Hierbei gelten spezifische von der EU definierte Kriterien.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*



### **Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Die vom Teilfonds berücksichtigte wichtigste nachteilige Auswirkungen waren:

- Treibhausgasintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1 und Scope 2)
- Verstöße gegen die Prinzipien des UNGC und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD)
- Anteil der Investitionen mit Beteiligung an umstrittenen Waffen

Der Ansatz zur Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen beinhaltete unter anderem, dass HSBC das Engagement der Unternehmen für den Übergang zu kohlenstoffarmem Wirtschaften, die zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern sowie die Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette prüfte, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails. Ebenfalls berücksichtigt wurde das Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit den Bereichen demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.

Das Screening führte dazu, dass HSBC nicht in bestimmte Unternehmen und Emittenten investierte.



## Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der Investitionen** entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden: basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des Bezugszeitraums zum 31.03.2024

| Größte Investitionen  | Sektor                  | % der Vermögenswerte | Land                           |
|---|-------------------------|----------------------|--------------------------------|
| European Investment Bank 3,75 %<br>14.02.2033               | Staatsanleihen          | 3,12 %               | SUPRANATIONAL                  |
| Government Of Italy 4,0 %<br>30.10.2031                     | Staatsanleihen          | 2,71 %               | Italien                        |
| Societe Du Grand Paris 1,125 %<br>22.10.2028                | Andere                  | 2,64 %               | Frankreich                     |
| European Union 0,4 % 04.02.2037                             | Staatsanleihen          | 2,50 %               | SUPRANATIONAL                  |
| Government Of Germany 0,0 %<br>15.08.2050                   | Staatsanleihen          | 2,27 %               | Deutschland                    |
| Kfw 2,75 % 14.02.2033                                       | Staatsanleihen          | 1,94 %               | Deutschland                    |
| Societe Nationale SnCF 3,375 %<br>25.05.2033                | Industriegüter          | 1,80 %               | Frankreich                     |
| Bnp Paribas S.a. 1,675 %<br>30.06.2027                      | Finanzen                | 1,77 %               | Frankreich                     |
| Government Of Belgium 2,75 %<br>22.04.2039                  | Staatsanleihen          | 1,68 %               | Belgien                        |
| Deutsche Bank Ag, New York<br>Branch 1,686 % 19.03.2026     | Finanzen                | 1,65 %               | Deutschland                    |
| Nederlandse Waterschapsbank N.v.<br>3,0 % 20.04.2033        | Finanzen                | 1,61 %               | Niederlande                    |
| Toronto-dominion Bank 1,25 %<br>13.12.2024                  | Finanzen                | 1,56 %               | Kanada                         |
| Apple Inc. 3,0 % 20.06.2027                                 | Informationstechnologie | 1,55 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Ing Groep N.v. 4,625 % 06.01.2026                           | Finanzen                | 1,51 %               | Niederlande                    |
| Banco Bilbao Vizcaya Argentaria,<br>S.a. 4,375 % 14.10.2029 | Finanzen                | 1,49 %               | Spanien                        |

Barmittel und Derivate wurden nicht berücksichtigt

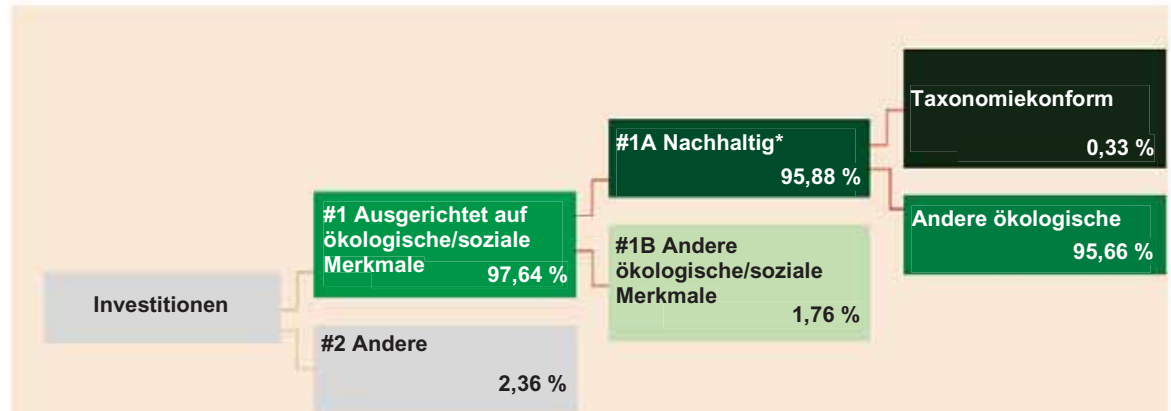


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

95,88 % des Portfolios waren in nachhaltige Vermögenswerte investiert.

Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?



**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**#2 Andere Investitionen** umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:  
 - Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.  
 - Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

\* Ein Unternehmen oder Emittent, das bzw. der als nachhaltige Investition angesehen wird, kann sowohl zu einem sozialen als auch zu einem ökologischen Ziel beitragen, das an der EU-Taxonomie ausgerichtet sein kann oder nicht. Die Zahlen in der obigen Grafik berücksichtigen dies. Jedoch darf eine Gesellschaft oder ein Emittent unter dem Punkt der nachhaltigen Investitionen (#1A Nachhaltige Investitionen) nur einmal erfasst werden.

Die Prozentzahlen von taxonomiekonformen Investitionen und Andere ökologische Merkmale stimmen aufgrund der unterschiedlichen Berechnungsmethoden für nachhaltige Investitionen und taxonomiekonforme Investitionen nicht mit #1A Nachhaltige Investitionen überein.

### In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

| Sektor / Teilsektor            | % der Vermögenswerte |
|--------------------------------|----------------------|
| Finanzen                       | 29,70 %              |
| Staatsanleihen                 | 23,79 %              |
| Andere                         | 23,36 %              |
| Versorger                      | 9,11 %               |
| Stromversorgungsbetriebe       | 4,85 %               |
| Erdgas                         | 0,54 %               |
| Multi-Versorger                | 3,71 %               |
| Kommunikationsdienstleistungen | 3,96 %               |
| Immobilien                     | 3,00 %               |
| Barmittel und Derivate         | 2,36 %               |
| Industriegüter                 | 1,63 %               |
| Informationstechnologie        | 1,53 %               |
| Zyklische Konsumgüter          | 0,83 %               |
| Basiskonsumgüter               | 0,73 %               |
| Summe                          | 100,00 %             |



## Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen ist in den obigen Feldern zur Vermögensallokation ersichtlich.

### Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

Ja:
   
 In fossiles Gas
   
 In Kernenergie
   
 Nein

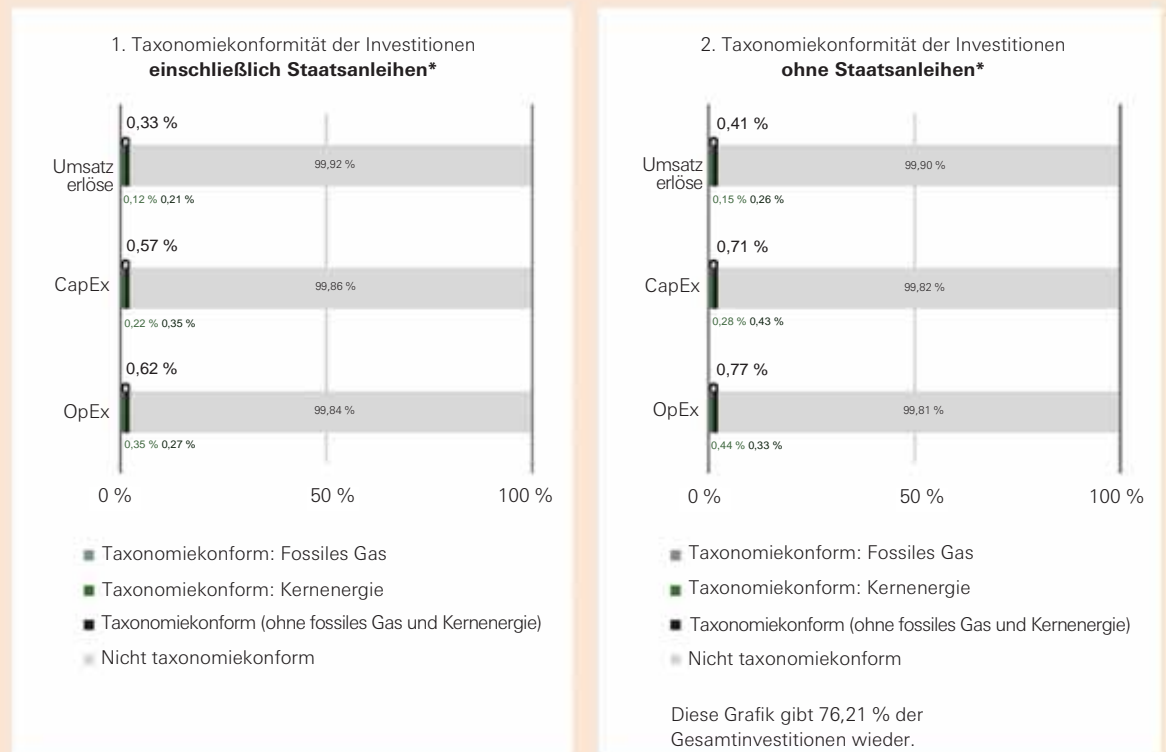
<sup>1</sup> Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

**Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

*Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.*



\* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

### Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?


Im Referenzzeitraum betrug der Anteil der Investitionen des Fonds, die in Übergangstätigkeiten geflossen sind, 0,12 % und der Anteil der Investitionen, die in ermöglichende Tätigkeiten geflossen ist, 0,10 %.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

| Indikator   | 2023-2024 | 2022-2023 |
|---|-----------|-----------|
| Umsatz – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                       | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform: Kernenergie                        | 0,12 %    | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie) | 0,21 %    | 0,00 %    |
| Umsatz – Nicht taxonomiekonform                               | 99,92 %   | 100,00 %  |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                        | n. z.     | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                         | 0,22 %    | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)  | 0,35 %    | 0,00 %    |
| CAPEX – Nicht taxonomiekonform                                | 99,86 %   | 100,00 %  |
| OPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                         | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                          | 0,35 %    | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)   | 0,27 %    | 0,00 %    |
| OPEX – Nicht taxonomiekonform                                 | 99,84 %   | 100,00 %  |

Da es sich erst um den zweiten Berichtszeitraum des Teilfonds handelt, ist ein Vergleich mit der Zeit davor nicht erforderlich.

 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?**

Der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel war 95,66 %. Der Teilfonds hat sich nicht verpflichtet, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen.

 **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Teilfonds investierte nicht in sozial nachhaltige Anlagen.

 **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

#2 Andere Investitionen umfasst die Finanzinstrumente, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden. In manchen Fällen ist dies auf die Nichtverfügbarkeit von Daten und Unternehmensmaßnahmen zurückzuführen. Diese Positionen unterlagen nach wie vor dem vollständigen Ausschluss-Screening von HSBC und wurden im Hinblick auf verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Prinzipien des UNGC und der OECD geprüft.

Der Teilfonds hielt Barmittel / Barmitteläquivalente (der Prozentsatz der gehaltenen Barmittel ist in der obigen Tabelle der Sektoren/Teilsektoren unter der Überschrift „In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?“ ersichtlich) zum Zwecke des Liquiditätsmanagements sowie derivative Finanzinstrumente zum Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements. Barmittel / Barmitteläquivalente und derivative Finanzinstrumente verfügen aufgrund der Art dieser Instrumente über keinen ökologischen oder sozialen Mindestschutz.





## Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Im Laufe des Berichtszeitraums schloss der Anlageberater unter anderem verbotene Waffen, umstrittene Waffen, Unternehmen, die mehr als 10 % ihres Umsatzes aus Kraftwerkskohle und Energieerzeugung aus Kohle generieren, und Tabakherstellung aus und investierte in Unternehmen mit verantwortungsvollen Geschäftspraktiken gemäß den Prinzipien des UNGC.

Alle Positionen des Portfolios wurden hinsichtlich ihrer individuellen Treibhausgasintensität bewertet, was zu PAI-Scores führte, die im Einklang mit denen des Referenzwerts lagen. Der Teilfonds bewertete auch ESG-Scores mit dem Ergebnis, dass der ESG-Score während des gesamten Berichtszeitraums im Einklang mit dem des Referenzwerts lag.

Der Anlageberater bewertete die Geschlechtervielfalt in den Unternehmensvorständen, was zu einem etwas niedrigeren PAI-Score als der Referenzwert führte.

Darüber hinaus wurden alle Positionen auf Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der OECD untersucht, um Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung innerhalb des Portfolios sicherzustellen.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend.

● **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Nicht zutreffend.

● **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?**

Nicht zutreffend.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen 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.

Name des Produkts: HSBC GLOBAL INVESTMENT FUNDS - GLOBAL HIGH INCOME BOND

Unternehmenskennung (LEI-Code): 4Z04JLSNEZGELBE69R05

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

| Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?  |   |
|--|---|
| <input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> Ja  | <input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> Nein   |
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel</b> getätigt: _ %<br><br><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><br><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit <b>ökologische/soziale Merkmale beworben</b> und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 17,78 % an nachhaltigen Investitionen<br><br><input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><br><input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><br><input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel |
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel</b> getätigt: _ %  | <input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber <b>keine nachhaltigen Investitionen getätigt</b>   |



### Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Während des Geschäftsjahres zum 31. März 2024 (der Bezugszeitraum) bewarb der Teilfonds die folgenden Merkmale:

- Der Teilfonds investierte in Wertpapiere, die Klimaschutz- oder umweltschutzbezogene Projekte unterstützten.
- Der Teilfonds berücksichtigte verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Grundsätzen des Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC) und den Leitsätzen für multinationale Unternehmen der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für Unternehmen. Wurden potenzielle Verstöße gegen die Prinzipien des UNGC festgestellt, wurden die Emittenten einer eigenen Due-Diligence-Prüfung hinsichtlich ESG-Themen unterzogen, um festzustellen, ob sie für die Aufnahme in das Portfolio des Teilfonds geeignet sind, und sie auszuschließen, falls sie als ungeeignet erachtet wurden.
- Der Teilfonds schloss Geschäftstätigkeiten aus, die als umweltschädlich gelten, wie z. B. die Förderung von Kraftwerkskohle und die Kohleverstromung.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

4. Der Teilfonds prüfte und analysierte alle Unternehmen oder Emittenten im Hinblick auf ökologische Merkmale, insbesondere physische Risiken durch den Klimawandel und Personalmanagement.
5. Der Teilfonds berücksichtigte aktiv ökologische und soziale Aspekte, indem er über unsere Engagement- und Stewardship-Teams Mitwirkung bei Emittenten umsetzte, wo HSBC Asset Management dies für angemessen hielt.
6. Der Teilfonds schloss nach entsprechender Analyse Anlagen in umstrittenen Waffen aus.

Die auf ESG und Nachhaltigkeitsindikatoren bezogenen Scores werden anhand der proprietären Methodik von HSBC Asset Management und externer ESG-Datenanbieter berechnet. Wir verwenden ESG-Scores von Drittanbietern (z. B. ESG-Scores von MSCI) und haben auch eigene Scores entwickelt, um unsere eigene Sicht der ESG-Risiken und -Chancen widerzuspiegeln. Wir haben eine maßgeschneiderte Branchensegmentierung entwickelt (abgeleitet vom MSCI Global Industry Classification Standard), bei der wir die Wesentlichkeit der wichtigsten E-, S- und G-Faktoren von MSCI auf einer sektoralen Basis neu bewerten und eine sektorspezifische HSBC-ESG-Gewichtung erstellen.

Die Berücksichtigung einzelner wichtigster nachteiliger Auswirkungen (PAI) wird in der nachstehenden Tabelle anhand ihrer Nummerierung im Vergleich zum Referenzwert angegeben. Die bei der Berechnung der PAI-Werte verwendeten Daten stammen von externen Datenanbietern. Sie können auf Unternehmens-/Emittentenangaben basieren oder von den Datenanbietern geschätzt werden, wo keine solchen Angaben vorliegen. Bitte beachten Sie, dass es nicht immer möglich ist, die Richtigkeit, Aktualität oder Vollständigkeit der von Drittanbietern bereitgestellten Daten zu garantieren.

Der Referenzwert wurde für den Marktvergleich herangezogen, diente aber nicht der Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale des Teilfonds.

Das Abschneiden der Nachhaltigkeitsindikatoren, die der Teilfonds zur Messung der Erreichung der von ihm beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet, ist in der folgenden Tabelle dargestellt. Es wurde auf das Erreichen eines ESG-Score des Teilfonds hingearbeitet, der über dem vom Teilfonds ausgewählten Referenzindex liegt (ein höherer Score als der Referenzwert bedeutet bessere ESG-Referenzen).

Alle Unternehmen/Emittenten haben eine gute Unternehmensführung bewiesen, was sich am PAI-Score 10 unten ablesen lässt.

### **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

| <b>Indikator</b>   | <b>Teilfonds</b> | <b>Referenzwert</b> |
|--|------------------|---------------------|
| E-Säule  | 6,66             | 6,23                |
| S-Säule  | 5,37             | 5,10                |
| G-Säule  | 5,78             | 5,65                |
| Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen  | 35,05            | 33,66               |
| Treibhausgasintensität (Scope 1 & 2)   | 161,54           | 259,05              |
| Ausschlüsse (UNGC/OECD)  | 0,80             | 2,17                |
| 1. THG-Emissionen – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente  | 37.512,38        | 719,35              |
| 8. Emissionen in Wasser – in tausend metrische Tonnen pro Million Euro Investition                         | 0,00             | 0,00                |
| 12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle   | 12,05 %          | 12,37 %             |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) | 0,00 %           | 0,25 %              |

Die Daten in diesem regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung beziehen sich auf den Stand vom 31. März 2024, basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des am 31. März 2024 endenden Geschäftsjahres.

Referenzwert - BMK\_HGIF Global High Income Bond

### ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

| Indikator  | Zeitraum zum  | Teilfonds | Referenzwert |
|--|---------------|-----------|--------------|
| E-Säule  | 31. März 2024 | 6,66      | 6,23         |
|  | 31. März 2023 | 6,54      | 7,18         |
| S-Säule  | 31. März 2024 | 5,37      | 5,10         |
|  | 31. März 2023 | 5,24      | 4,96         |
| G-Säule  | 31. März 2024 | 5,78      | 5,65         |
|  | 31. März 2023 | 5,54      | 5,82         |
| Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen  | 31. März 2024 | 35,05     | 33,66        |
|  | 31. März 2023 | 0,00      | 0,00         |
| Treibhausgasintensität (Scope 1 & 2)   | 31. März 2024 | 161,54    | 259,05       |
|  | 31. März 2023 | 0,00      | 0,00         |
| Ausschlüsse (UNGC/OECD)  | 31. März 2024 | 0,80      | 2,17         |
|  | 31. März 2023 | 0,00      | 0,00         |
| 1. THG-Emissionen – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente  | 31. März 2024 | 37.512,38 | 719,35       |
|  | 31. März 2023 | 0,00      | 0,00         |
| 8. Emissionen in Wasser – in tausend metrische Tonnen pro Million Euro Investition                         | 31. März 2024 | 0,00      | 0,00         |
|  | 31. März 2023 | 0,00      | 0,00         |
| 12. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle   | 31. März 2024 | 12,05 %   | 12,37 %      |
|  | 31. März 2023 | 0,00 %    | 0,00 %       |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) | 31. März 2024 | 0,00 %    | 0,25 %       |
|  | 31. März 2023 | 0,00 %    | 0,01 %       |

Da es sich erst um den zweiten regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung handelt, ist kein Vergleich mit vorangegangenen Zeiträumen möglich.

### Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Die vom Teilfonds getätigten nachhaltigen Investitionen trugen unter anderem zu folgenden ökologischen Zielen bei:

1. Reduzierung von Treibhausgasemissionen und Verringerung des CO<sub>2</sub>-Fußabdrucks;
2. Übergang zu oder die Nutzung von erneuerbarer Energie.

Der Teilfonds identifizierte und analysierte ESG-Referenzen eines Unternehmens als wesentlichen Bestandteil des Anlageentscheidungsprozesses für die Portfoliokonstruktion mit dem Ziel, Nachhaltigkeitsrisiken zu reduzieren und Renditen zu steigern. Der Anlageberater zielt darauf ab, durch Berücksichtigung der ESG-Referenzen potenzieller Investitionen einen besseren ESG-Score zu erzielen als der Referenzwert.

### Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Wir bestätigen, dass wir nachhaltige Vermögenswerte darauf geprüft haben, ob sie erhebliche Beeinträchtigungen verursachen können. Dies erfolgte im Rahmen des Standard-Anlageprozesses von HSBC Asset Management (HSBC) und unter Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen.

*Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?*

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 Anlageberater hat alle durch die Offenlegungsverordnung definierten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI) auf ihre Relevanz für den Teilfonds geprüft. Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren legt fest, wie HSBC die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen identifiziert und darauf reagiert, und in welcher Form HSBC Nachhaltigkeitsrisiken berücksichtigt, die sich negativ auf Wertpapiere auswirken können, in die der Teilfonds investiert. HSBC identifizierte in Zusammenarbeit mit externen Screening-Dienstleistern wie Sustainalytics, ISS, MSCI und Trucost Unternehmen und Staaten mit schlechter Bilanz beim Management von ESG-Risiken, und wo solche wesentlichen Risiken identifiziert wurden, führte HSBC zusätzliche Due Diligence-Prüfungen durch. Durch Screening identifizierte Nachhaltigkeitsauswirkungen, einschließlich der relevanten PAI, bildeten einen Schlüsselfaktor beim Anlageentscheidungsprozess.

Der oben beschriebene Ansatz führte dazu, dass unter anderem folgende Faktoren geprüft wurden:

- Engagement der Unternehmen für den Übergang zu CO<sub>2</sub>-armen Wirtschaften, zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern, Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus großen Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails; und
- Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit folgenden Bereichen: demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.

Die spezifischen PAI für diesen Teilfonds waren wie unten beschrieben.

Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren ist auf der Website [www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies](http://www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies) verfügbar.

*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:*

HSBC hat sich der Anwendung und Förderung globaler Standards verpflichtet. Die wichtigsten Schwerpunktbereiche der Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren entsprachen den zehn UNGC-Grundsätzen. Diese Grundsätze stehen in Zusammenhang mit nicht finanziellen Risiken in den Bereichen Menschenrechte, Arbeit, Umweltschutz und Korruptionsbekämpfung. HSBC gehört darüber hinaus zu den Unterzeichnern der UN Principles for Responsible Investment. Diese bildeten den Rahmen für Ermittlung und Management von Nachhaltigkeitsrisiken beim Investmentansatz von HSBC. Von Unternehmen, in die der Teilfonds investierte, wurde erwartet, dass sie die Anforderungen des UNGC und der damit verbundenen Standards erfüllen. Unternehmen, die belegbar gegen einen der zehn Grundsätze des UNGC verstießen, wurden systematisch ausgeschlossen. Der Teilfonds führte verstärkte Due-Diligence-Prüfungen bei Unternehmen durch, die als nicht konform mit den Prinzipien des UNGC angesehen wurden oder die nach den unternehmenseigenen ESG Ratings von HSBC als risikoreich angesehen wurden. Darüber hinaus wurden die Unternehmen nach internationalen Standards wie den OECD-Leitsätzen bewertet.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen. Hierbei gelten spezifische von der Union definierte Kriterien.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*



### **Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Die vom Teilfonds berücksichtigte wichtigste nachteilige Auswirkungen waren:

- Treibhausgasintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1 und Scope 2)
- Verstöße gegen die Prinzipien des UNGC und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD)
- Anteil der Investitionen mit Beteiligung an umstrittenen Waffen

Der Ansatz zur Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen beinhaltete unter anderem, dass HSBC das Engagement der Unternehmen für den Übergang zu kohlenstoffarmem Wirtschaften, die zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern sowie die Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette prüfte, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails. Ebenfalls berücksichtigt wurde das Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit den Bereichen demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.

Das Screening führte dazu, dass HSBC nicht in bestimmte Unternehmen und Emittenten investierte.



## Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der Investitionen** entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden: basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des Bezugszeitraums zum 31.03.2024

| <b>Größte Investitionen</b>   | <b>Sektor</b>                   | <b>% der Vermögenswerte</b> | <b>Land</b>                    |
|---|---------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|
| HSBC US Dollar Liquidity Y 10116567   | Andere                          | 2,57 %                      | Irland                         |
| CCO Holdings, LLC 7,375 % 01.03.2031  | Kommunikations-dienstleistungen | 0,86 %                      | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Venture Global Lng, Inc. 8,375 % 01.06.2031                                   | Energie                         | 0,70 %                      | Vereinigte Staaten von Amerika |
| ICE_CDS CHASUS33 20/12/2028<br>SELL CHINA GOVT INTL BOND 7<br>COSP9F8XCA      | Andere                          | 0,68 %                      | @NA                            |
| Credit Suisse (New York Securities Branch) 3,625 % 09.09.2024                 | Finanzen                        | 0,67 %                      | Schweiz                        |
| Labl, Inc. 9,5 % 01.11.2028   | Grundstoffe                     | 0,67 %                      | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Intesa Sanpaolo S.p.a. 3,875 % 14.07.2027                                     | Finanzen                        | 0,63 %                      | Italien                        |
| United Airlines 2020-1 Class A Pass Through Trust 5,875 % 15.10.2027          | Industriegüter                  | 0,62 %                      | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Government Of Germany 2,3 % 15.02.2033  | Staatsanleihen                  | 0,59 %                      | Deutschland                    |
| HSBC Global Investment Funds SICAV - Asia High Yield Bond -ZC- Capitalisation | Andere                          | 0,57 %                      | Luxemburg                      |
| Veolia Environnement SA 2,25 % Perp   | Versorger                       | 0,56 %                      | Frankreich                     |
| Government Of The United States Of America 2,75 % 15.08.2032                  | Staatsanleihen                  | 0,55 %                      | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Galaxy Pipeline Assets Bidco Limited 2,625 % 31.03.2036                       | Energie                         | 0,54 %                      | Vereinigte Arabische Emirate   |
| Skandinaviska Enskilda Banken Ab 3,875 % 09.05.2028                           | Finanzen                        | 0,53 %                      | Schweden                       |
| Totalenergies Se 1,625 % Perp   | Energie                         | 0,52 %                      | Frankreich                     |

Barmittel und Derivate wurden nicht berücksichtigt

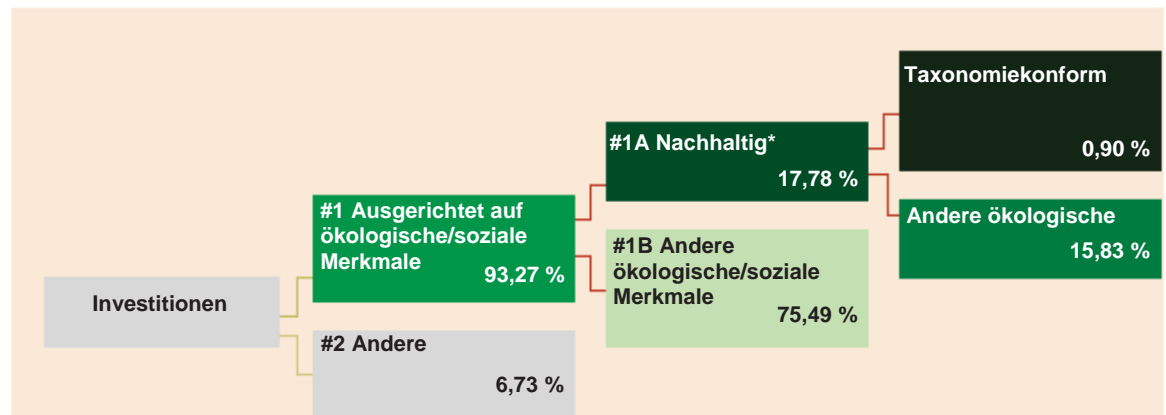


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

17,78 % des Portfolios waren in nachhaltige Vermögenswerte investiert.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

### ● *Wie sah die Vermögensallokation aus?*



**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**#2 Andere Investitionen** umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

\* Ein Unternehmen oder Emittent, das bzw. der als nachhaltige Investition angesehen wird, kann sowohl zu einem sozialen als auch zu einem ökologischen Ziel beitragen, das an der EU-Taxonomie ausgerichtet sein kann oder nicht. Die Zahlen in der obigen Grafik berücksichtigen dies. Jedoch darf eine Gesellschaft oder ein Emittent unter dem Punkt der nachhaltigen Investitionen (#1A Nachhaltige Investitionen) nur einmal erfasst werden.

Die Prozentzahlen von taxonomiekonformen Investitionen und Andere ökologische Merkmale stimmen aufgrund der unterschiedlichen Berechnungsmethoden für nachhaltige Investitionen und taxonomiekonforme Investitionen nicht mit #1A Nachhaltige Investitionen überein.



## In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

| Sektor / Teilsektor                                   | % der Vermögenswerte |
|---|----------------------|
| Finanzen  | 26,99 %              |
| Andere  | 22,31 %              |
| <i>Erdgas</i>   | <i>0,01 %</i>        |
| <i>Ausrüstung und Dienstleistungen für Öl und Gas</i> | <i>0,53 %</i>        |
| <i>Exploration und Produktion von Öl und Gas</i>      | <i>0,39 %</i>        |
| <i>Raffination und Vertrieb von Öl und Gas</i>        | <i>0,26 %</i>        |
| <i>Lagerung und Transport von Öl und Gas</i>          | <i>1,79 %</i>        |
| Staatsanleihen  | 20,62 %              |
| Energie   | 6,84 %               |
| <i>Integrierter Öl- und Gaskonzern</i>                | <i>1,42 %</i>        |
| <i>Ausrüstung und Dienstleistungen für Öl und Gas</i> | <i>0,17 %</i>        |
| <i>Exploration und Produktion von Öl und Gas</i>      | <i>1,77 %</i>        |
| <i>Raffination und Vertrieb von Öl und Gas</i>        | <i>0,49 %</i>        |
| <i>Lagerung und Transport von Öl und Gas</i>          | <i>2,99 %</i>        |
| Kommunikationsdienstleistungen                        | 6,29 %               |
| Grundstoffe   | 5,47 %               |
| Versorger   | 4,59 %               |
| <i>Stromversorgungsbetriebe</i>                       | <i>3,13 %</i>        |
| <i>Unabhängige Stromerzeuger und Energiehändler</i>   | <i>0,15 %</i>        |
| <i>Multi-Versorger</i>                                | <i>0,73 %</i>        |
| Industriegüter  | 4,14 %               |
| Zyklische Konsumgüter                                 | 3,70 %               |
| Immobilien  | 2,66 %               |
| Gesundheitswesen                                      | 2,12 %               |
| Basiskonsumgüter                                      | 1,22 %               |
| Informationstechnologie                               | 1,11 %               |
| Barmittel und Derivate                                | -8,06 %              |
| Summe   | 100,00 %             |



## Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

Der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen ist in den obigen Feldern zur Vermögensallokation ersichtlich.

### Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonmiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonmiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonmiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU)

Mit Blick auf die EU-Taxonmiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Kraftstoffe bis Ende 2035.

Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen.

- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

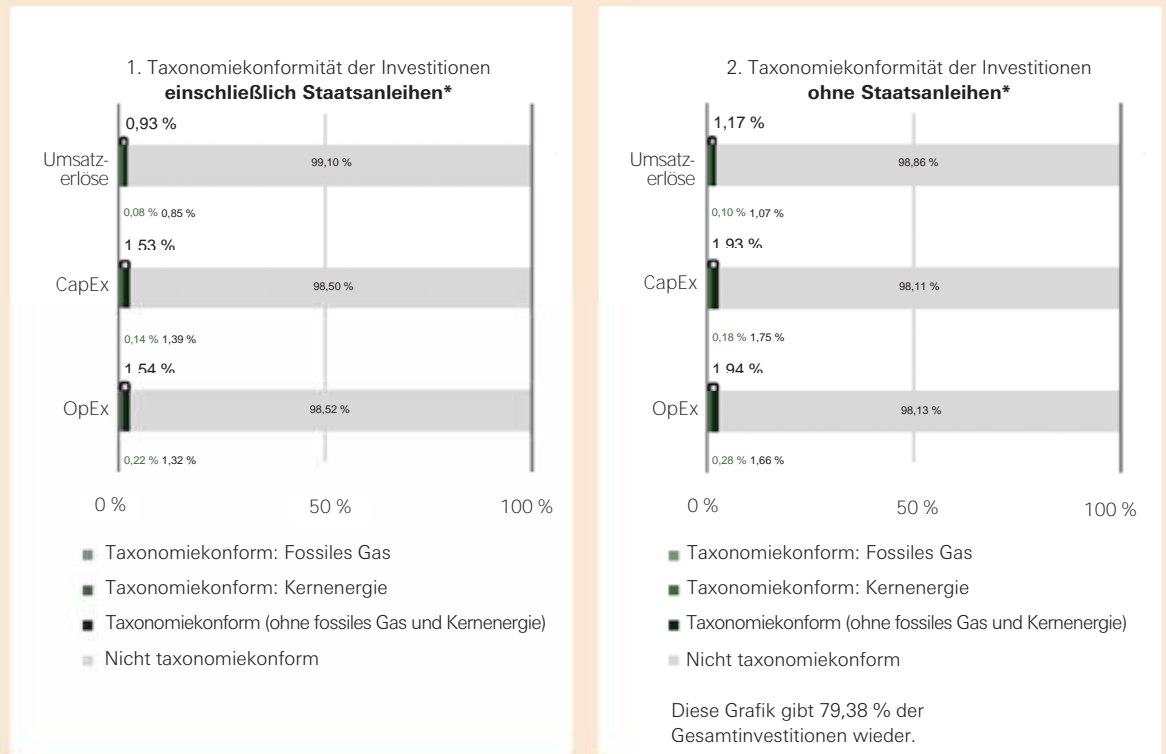
### Übergangstätigkeiten

sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

### Ermöglichende Tätigkeiten

wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

**Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.**



\* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

### Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Im Referenzzeitraum betrug der Anteil der Investitionen des Fonds, die in Übergangstätigkeiten geflossen sind, 0,06 % und der Anteil der Investitionen, die in ermöglichende Tätigkeiten geflossen ist, 0,48 %.

### Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

| Indikator   | 2023-2024 | 2022-2023 |
|---|-----------|-----------|
| Umsatz – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                       | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform: Kernenergie                        | 0,08 %    | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie) | 0,85 %    | 0,00 %    |
| Umsatz – Nicht taxonomiekonform                               | 99,10 %   | 100,00 %  |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                        | 0,00 %    | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                         | 0,14 %    | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)  | 1,39 %    | 0,00 %    |
| CAPEX – Nicht taxonomiekonform                                | 98,50 %   | 100,00 %  |
| OPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                         | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                          | 0,22 %    | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)   | 1,32 %    | 0,00 %    |
| OPEX – Nicht taxonomiekonform                                 | 98,52 %   | 100,00 %  |

Da es sich erst um den zweiten Berichtszeitraum des Teilfonds handelt, ist ein Vergleich mit der Zeit davor nicht erforderlich.



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?**

Der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel war 15,83 %. Der Teilfonds hat sich nicht verpflichtet, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen.



### **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Teilfonds investierte nicht in sozial nachhaltige Anlagen.



### **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

#2 Andere Investitionen umfasst die Finanzinstrumente, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden. In manchen Fällen ist dies auf die Nichtverfügbarkeit von Daten und Unternehmensmaßnahmen zurückzuführen. Diese Positionen unterlagen nach wie vor dem vollständigen Ausschluss-Screening von HSBC und wurden im Hinblick auf verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Prinzipien des UNGC und der OECD geprüft.

Der Teilfonds hielt Barmittel / Barmitteläquivalente (der Prozentsatz der gehaltenen Barmittel ist in der obigen Tabelle der Sektoren/Teilsektoren unter der Überschrift „In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?“ ersichtlich) zum Zwecke des Liquiditätsmanagements sowie derivative Finanzinstrumente zum Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements. Barmittel / Barmitteläquivalente und derivative Finanzinstrumente verfügen aufgrund der Art dieser Instrumente über keinen ökologischen oder sozialen Mindestschutz.



### **Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?**

Im Laufe des Berichtszeitraums schloss der Anlageberater unter anderem verbotene Waffen, umstrittene Waffen, Unternehmen, die mehr als 10 % ihres Umsatzes aus Kraftwerkskohle und Energieerzeugung aus Kohle generieren, und Tabakherstellung aus und investierte in Unternehmen mit verantwortungsvollen Geschäftspraktiken gemäß den Prinzipien des UNGC.

Nach der Identifizierung des zulässigen Anlageuniversums konstruierte der Anlageberater ein Portfolio, dessen CO<sub>2</sub>-Intensität (berechnet als gewichteter Durchschnitt der CO<sub>2</sub>-Intensitäten der Anlagen des Teilfonds) niedriger ist als der gewichtete Durchschnitt der Bestandteile des Referenzwerts. Dies führte zu einem PAI-Score, der unter dem Referenzwert lag. Der Teilfonds bewertete auch ESG-Scores mit dem Ergebnis, dass der ESG-Score während des gesamten Berichtszeitraums über dem des Referenzwerts lag.

Darüber hinaus wurden alle Positionen auf Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der OECD untersucht, um Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung innerhalb des Portfolios sicherzustellen.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Nicht zutreffend.

- **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?**

Nicht zutreffend.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen 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.

Name des Produkts: HSBC GLOBAL INVESTMENT FUNDS - GLOBAL HIGH YIELD ESG BOND

Unternehmenskennung (LEI-Code): 21380045AQUJTDKLN49

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

| Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?  |   |
|--|---|
| <input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> Ja  | <input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> Nein   |
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel</b> getätigt: _ %<br><br><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><br><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit <b>ökologische/soziale Merkmale beworben</b> und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 11,87 % an nachhaltigen Investitionen<br><br><input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><br><input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><br><input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel |
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel</b> getätigt: _ %  | <input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber <b>keine nachhaltigen Investitionen getätigt</b>   |



### Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Während des Geschäftsjahres zum 31. März 2024 (der Bezugszeitraum) bewarb der Teilfonds die folgenden Merkmale:

- Der Teilfonds investierte in Wertpapiere, die Klimaschutz- oder umweltschutzbezogene Projekte unterstützten.
- Der Teilfonds berücksichtigte verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Grundsätzen des Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC) und den Leitsätzen für multinationale Unternehmen der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für Unternehmen. Wurden potenzielle Verstöße gegen die Prinzipien des UNGC festgestellt, wurden die Emittenten einer eigenen Due-Diligence-Prüfung hinsichtlich ESG-Themen unterzogen, um festzustellen, ob sie für die Aufnahme in das Portfolio des Teilfonds geeignet sind, und sie auszuschließen, falls sie als ungeeignet erachtet wurden.
- Der Teilfonds schloss Geschäftstätigkeiten aus, die als umweltschädlich gelten, wie z. B. die Förderung von Kraftwerkskohle und die Kohleverstromung.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

4. Der Teilfonds prüfte und analysierte alle Unternehmen oder Emittenten im Hinblick auf ökologische Merkmale, insbesondere physische Risiken durch den Klimawandel und Personalmanagement.
5. Der Teilfonds berücksichtigte aktiv ökologische und soziale Aspekte, indem er über unsere Engagement- und Stewardship-Teams Mitwirkung bei Emittenten umsetzte, wo HSBC Asset Management dies für angemessen hielt.
6. Der Teilfonds schloss nach entsprechender Analyse Anlagen in umstrittenen Waffen aus.

Die auf ESG und Nachhaltigkeitsindikatoren bezogenen Scores werden anhand der proprietären Methodik von HSBC Asset Management und externer ESG-Datenanbieter berechnet. Wir verwenden ESG-Scores von Drittanbietern (z. B. ESG-Scores von MSCI) und haben auch eigene Scores entwickelt, um unsere eigene Sicht der ESG-Risiken und -Chancen widerzuspiegeln. Wir haben eine maßgeschneiderte Branchensegmentierung entwickelt (abgeleitet vom MSCI Global Industry Classification Standard), bei der wir die Wesentlichkeit der wichtigsten E-, S- und G-Faktoren von MSCI auf einer sektoralen Basis neu bewerten und eine sektorspezifische HSBC-ESG-Gewichtung erstellen.

Die Berücksichtigung einzelner wichtigster nachteiliger Auswirkungen (PAI) wird in der nachstehenden Tabelle anhand ihrer Nummerierung im Vergleich zum Referenzwert angegeben. Die bei der Berechnung der PAI-Werte verwendeten Daten stammen von externen Datenanbietern. Sie können auf Unternehmens-/Emittentenangaben basieren oder von den Datenanbietern geschätzt werden, wo keine solchen Angaben vorliegen. Bitte beachten Sie, dass es nicht immer möglich ist, die Richtigkeit, Aktualität oder Vollständigkeit der von Drittanbietern bereitgestellten Daten zu garantieren. Der Referenzwert wurde für den Marktvergleich herangezogen, diente aber nicht der Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale des Teilfonds.

Das Abschneiden der Nachhaltigkeitsindikatoren, die der Teilfonds zur Messung der Erreichung der von ihm beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet, ist in der folgenden Tabelle dargestellt. Es wurde auf das Erreichen eines ESG-Score des Teilfonds hingearbeitet, der über dem vom Teilfonds ausgewählten Referenzindex liegt (ein höherer Score als der Referenzwert bedeutet bessere ESG-Referenzen).

Alle Unternehmen/Emittenten haben eine gute Unternehmensführung bewiesen, was sich am PAI-Score 10 unten ablesen lässt.

### **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

| <b>Indikator</b>   | <b>Teilfonds</b> | <b>Referenzwert</b> |
|--|------------------|---------------------|
| ESG-Score  | 6,76             | 5,64                |
| E-Säule  | 6,82             | 5,88                |
| S-Säule  | 5,12             | 4,75                |
| G-Säule  | 6,09             | 5,39                |
| 1. THG-Emissionen – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente  | 2.163,21         | 198.703,51          |
| 2. CO <sub>2</sub> -Fußabdruck – Tonnen CO <sub>2</sub> pro Million Euro (EVIC)  | 67,51            | 124,21              |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente pro Million Euro Umsatz   | 131,12           | 337,95              |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 0,01 %           | 2,27 %              |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 0,00 %           | 0,00 %              |

Die Daten in diesem regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung beziehen sich auf den Stand vom 31. März 2024, basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des am 31. März 2024 endenden Geschäftsjahres.

Referenzwert - ICE BofA Global High Yield BB-B Constrained Index

### ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

| Indikator  | Zeitraum zum  | Teilfonds | Referenzwert |
|--|---------------|-----------|--------------|
| ESG-Score  | 31. März 2024 | 6,76      | 5,64         |
|  | 31. März 2023 | 6,35      | 5,39         |
| E-Säule  | 31. März 2024 | 6,82      | 5,88         |
|  | 31. März 2023 | 6,16      | 5,79         |
| S-Säule  | 31. März 2024 | 5,12      | 4,75         |
|  | 31. März 2023 | 5,05      | 4,56         |
| G-Säule  | 31. März 2024 | 6,09      | 5,39         |
|  | 31. März 2023 | 5,99      | 5,35         |
| 1. THG-Emissionen – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente  | 31. März 2024 | 2.163,21  | 198.703,51   |
|  | 31. März 2023 | 2.583,73  | 213.994,49   |
| 2. CO <sub>2</sub> -Fußabdruck – Tonnen CO <sub>2</sub> pro Million Euro (EVIC)  | 31. März 2024 | 67,51     | 124,21       |
|  | 31. März 2023 | 69,39     | 118,60       |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente pro Million Euro Umsatz   | 31. März 2024 | 131,12    | 337,95       |
|  | 31. März 2023 | 184,14    | 378,77       |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 31. März 2024 | 0,01 %    | 2,27 %       |
|  | 31. März 2023 | 0,00 %    | 3,40 %       |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 31. März 2024 | 0,00 %    | 0,00 %       |
|  | 31. März 2023 | 0,00 %    | 0,00 %       |

Da es sich erst um den zweiten regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung handelt, ist kein Vergleich mit vorangegangenen Zeiträumen möglich.

### **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die vom Teilfonds getätigten nachhaltigen Investitionen trugen unter anderem zu folgenden ökologischen Zielen bei:

1. Reduzierung von Treibhausgasemissionen und Verringerung des CO<sub>2</sub>-Fußabdrucks;
2. Übergang zu oder die Nutzung von erneuerbarer Energie.

Der Teilfonds identifizierte und analysierte ESG-Referenzen eines Unternehmens als wesentlichen Bestandteil des Anlageentscheidungsprozesses für die Portfoliokonstruktion mit dem Ziel, Nachhaltigkeitsrisiken zu reduzieren und Renditen zu steigern. Der Anlageberater zielt darauf ab, durch Berücksichtigung der ESG-Referenzen potenzieller Investitionen einen besseren ESG-Score zu erzielen als der Referenzwert.

### **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Wir bestätigen, dass wir nachhaltige Vermögenswerte darauf geprüft haben, ob sie erhebliche Beeinträchtigungen verursachen können. Dies erfolgte im Rahmen des Standard-Anlageprozesses von HSBC Asset Management (HSBC) und unter Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen.

*Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?*

Der Anlageberater hat alle durch die Offenlegungsverordnung definierten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI) auf ihre Relevanz für den Teilfonds geprüft. Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren legt fest, wie HSBC die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen identifiziert und darauf reagiert, und in welcher Form HSBC Nachhaltigkeitsrisiken berücksichtigt, die sich negativ auf Wertpapiere auswirken können, in die der Teilfonds investiert. HSBC identifizierte in Zusammenarbeit mit externen Screening-Dienstleistern wie Sustainalytics, ISS, MSCI und Trucost Unternehmen und Staaten mit schlechter Bilanz beim Management von ESG-Risiken, und wo solche wesentlichen Risiken identifiziert wurden, führte HSBC zusätzliche Due Diligence-Prüfungen durch. Durch Screening identifizierte Nachhaltigkeitsauswirkungen, einschließlich der relevanten PAI, bildeten einen Schlüsselfaktor beim Anlageentscheidungsprozess.

Der oben beschriebene Ansatz führte dazu, dass unter anderem folgende Faktoren geprüft wurden:

- Engagement der Unternehmen für den Übergang zu CO<sub>2</sub>-armen Wirtschaften, zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern, Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus großen Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails; und
- Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit folgenden Bereichen: demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.

Die spezifischen PAI für diesen Teilfonds waren wie unten beschrieben.

Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren ist auf der Website [www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies](http://www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies) verfügbar.

*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:*

HSBC hat sich der Anwendung und Förderung globaler Standards verpflichtet. Die wichtigsten Schwerpunktbereiche der Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren entsprachen den zehn UNGC-Grundsätzen. Diese Grundsätze stehen in Zusammenhang mit nicht finanziellen Risiken in den Bereichen Menschenrechte, Arbeit, Umweltschutz und Korruptionsbekämpfung. HSBC gehört darüber hinaus zu den Unterzeichnern der UN Principles for Responsible Investment. Diese bildeten den Rahmen für Ermittlung und Management von Nachhaltigkeitsrisiken beim Investmentansatz von HSBC. Von Unternehmen, in die der Teilfonds investierte, wurde erwartet, dass sie die Anforderungen des UNGC und der damit verbundenen Standards erfüllen. Unternehmen, die belegbar gegen einen der zehn Grundsätze des UNGC verstießen, wurden systematisch ausgeschlossen. Der Teilfonds führte verstärkte Due-Diligence-Prüfungen bei Unternehmen durch, die als nicht konform mit den Prinzipien des UNGC angesehen wurden oder die nach den unternehmenseigenen ESG Ratings von HSBC als risikoreich angesehen wurden. Darüber hinaus wurden die Unternehmen nach internationalen Standards wie den OECD-Leitsätzen bewertet.



In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen. Hierbei gelten spezifische von der Union definierte Kriterien.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*



### **Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Die vom Teilfonds berücksichtigte wichtigste nachteilige Auswirkungen waren:

- Treibhausgasintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1 und Scope 2)
- Verstöße gegen die Prinzipien des UNGC und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD)
- Anteil der Investitionen mit Beteiligung an umstrittenen Waffen

Der Ansatz zur Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen beinhaltete unter anderem, dass HSBC das Engagement der Unternehmen für den Übergang zu kohlenstoffarmem Wirtschaften, die zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern sowie die Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette prüfte, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails. Ebenfalls berücksichtigt wurde das Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit den Bereichen demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.

Das Screening führte dazu, dass HSBC nicht in bestimmte Unternehmen und Emittenten investierte.



## Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der Investitionen** entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden: basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des Bezugszeitraums zum 31.03.2024

| <b>Größte Investitionen</b>  | <b>Sektor</b>           | <b>% der Vermögenswerte</b> | <b>Land</b>                    |
|--|-------------------------|-----------------------------|--------------------------------|
| HSBC Global Investment Funds SICAV - Global Asset-Backed High Yield Bond Capitalisation -ZC- | Andere                  | 2,31 %                      | Luxemburg                      |
| HSBC US Dollar Liquidity Y 10116567  | Andere                  | 2,30 %                      | Irland                         |
| Iron Mountain Incorporated 5,25 % 15.07.2030   | Immobilien              | 1,27 %                      | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Chesapeake Energy Corporation 6,75 % 15.04.2029  | Energie                 | 1,26 %                      | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Archrock Partners LP 6,875 % 01.04.2027  | Energie                 | 1,23 %                      | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Constellium SE 5,625 % 15.06.2028  | Grundstoffe             | 1,23 %                      | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Encompass Health Corporation 4,5 % 01.02.2028  | Gesundheitswesen        | 1,22 %                      | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Travel + Leisure Co. 6,625 % 31.07.2026  | Zyklische Konsumgüter   | 1,21 %                      | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Trivium Packaging Finance BV 5,5 % 15.08.2026  | Grundstoffe             | 1,18 %                      | Niederlande                    |
| Iqvia Inc. 6,5 % 15.05.2030  | Gesundheitswesen        | 1,11 %                      | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Axalta Coating Systems LLC 4,75 % 15.06.2027   | Grundstoffe             | 1,08 %                      | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Tenet Healthcare Corporation 6,125 % 01.10.2028  | Gesundheitswesen        | 1,06 %                      | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Iqvia Inc. 2,875 % 15.06.2028  | Gesundheitswesen        | 1,05 %                      | Vereinigte Staaten von Amerika |
| FMG Resources (august 2006) Pty Ltd. 5,875 % 15.04.2030                                      | Grundstoffe             | 1,04 %                      | Australien                     |
| Seagate Hdd Cayman 8,25 % 15.12.2029   | Informationstechnologie | 1,00 %                      | Vereinigte Staaten von Amerika |

Barmittel und Derivate wurden nicht berücksichtigt

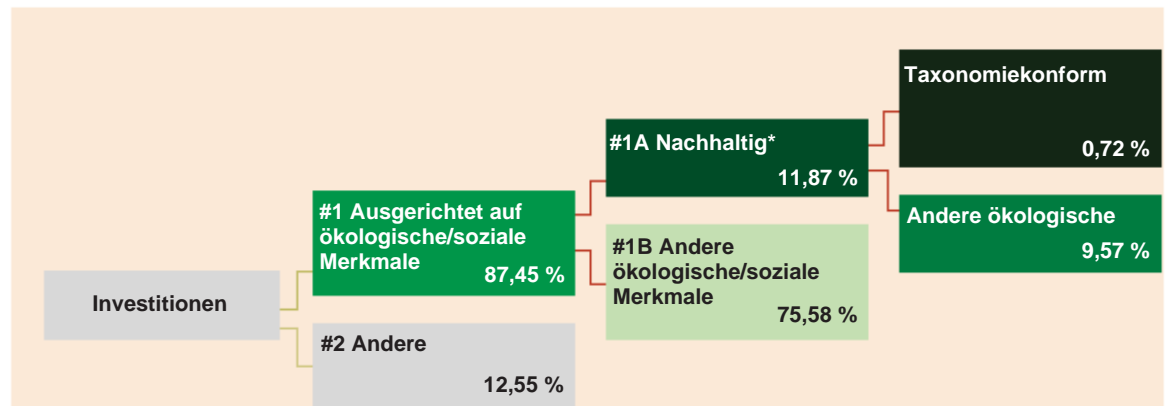


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

11,87 % des Portfolios waren in nachhaltige Vermögenswerte investiert.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

### ● *Wie sah die Vermögensallokation aus?*



**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**#2 Andere Investitionen** umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

\* Ein Unternehmen oder Emittent, das bzw. der als nachhaltige Investition angesehen wird, kann sowohl zu einem sozialen als auch zu einem ökologischen Ziel beitragen, das an der EU-Taxonomie ausgerichtet sein kann oder nicht. Die Zahlen in der obigen Grafik berücksichtigen dies. Jedoch darf eine Gesellschaft oder ein Emittent unter dem Punkt der nachhaltigen Investitionen (#1A Nachhaltige Investitionen) nur einmal erfasst werden.

Die Prozentzahlen von taxonomiekonformen Investitionen und Andere ökologische Merkmale stimmen aufgrund der unterschiedlichen Berechnungsmethoden für nachhaltige Investitionen und taxonomiekonforme Investitionen nicht mit #1A Nachhaltige Investitionen überein.

## In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

| Sektor / Teilsektor                                   | % der Vermögenswerte |
|---|----------------------|
| Andere  | 28,55 %              |
| <i>Ausrüstung und Dienstleistungen für Öl und Gas</i> | 1,24 %               |
| <i>Raffination und Vertrieb von Öl und Gas</i>        | 0,11 %               |
| <i>Lagerung und Transport von Öl und Gas</i>          | 0,59 %               |
| Zyklische Konsumgüter                                 | 11,89 %              |
| Grundstoffe   | 10,91 %              |
| Industriegüter  | 10,74 %              |
| Finanzen  | 8,28 %               |
| Kommunikationsdienstleistungen                        | 8,18 %               |
| Gesundheitswesen                                      | 7,29 %               |
| Energie   | 5,02 %               |
| <i>Exploration und Produktion von Öl und Gas</i>      | 2,57 %               |
| <i>Lagerung und Transport von Öl und Gas</i>          | 2,45 %               |
| Informationstechnologie                               | 3,17 %               |
| Versorger   | 2,57 %               |
| <i>Stromversorgungsbetriebe</i>                       | 1,88 %               |
| <i>Multi-Versorger</i>                                | 0,69 %               |
| Basiskonsumgüter                                      | 1,63 %               |
| Immobilien  | 1,50 %               |
| Staatsanleihen  | 0,15 %               |
| Barmittel und Derivate                                | 0,11 %               |
| Summe   | 100,00 %             |

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.



### Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

Der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen ist in den obigen Feldern zur Vermögensallokation ersichtlich.

#### Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

Ja:
   
 In fossiles Gas       In Kernenergie
   
 Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

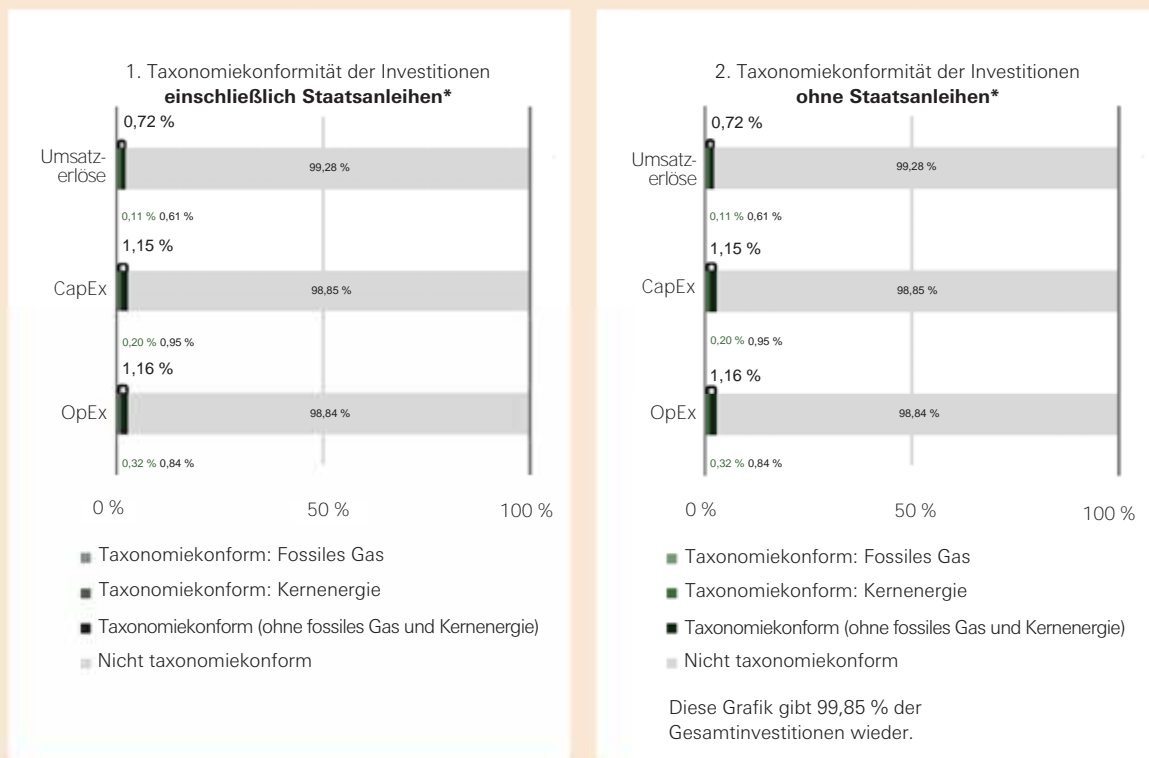
Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

**Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

**Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.**



\* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

**Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Im Referenzzeitraum betrug der Anteil der Investitionen des Fonds, die in Übergangstätigkeiten geflossen sind, 0,11 % und der Anteil der Investitionen, die in ermöglichende Tätigkeiten geflossen ist, 0,18 %.

**Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

| Indikator   | 2023-2024 | 2022-2023 |
|---|-----------|-----------|
| Umsatz – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                       | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform: Kernenergie                        | 0,11 %    | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie) | 0,61 %    | 0,00 %    |
| Umsatz – Nicht taxonomiekonform                               | 99,28 %   | 100,00 %  |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                        | 0,00 %    | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                         | 0,20 %    | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)  | 0,95 %    | 0,00 %    |
| CAPEX – Nicht taxonomiekonform                                | 98,85 %   | 100,00 %  |
| OPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                         | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                          | 0,32 %    | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)   | 0,84 %    | 0,00 %    |
| OPEX – Nicht taxonomiekonform                                 | 98,84 %   | 100,00 %  |

Da es sich erst um den zweiten Berichtszeitraum des Teilfonds handelt, ist ein Vergleich mit der Zeit davor nicht erforderlich.



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?**

Der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel war 9,57 %. Der Teilfonds hat sich nicht verpflichtet, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen.



### **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Teilfonds investierte nicht in sozial nachhaltige Anlagen.



### **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

#2 Andere Investitionen umfasst die Finanzinstrumente, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden. In manchen Fällen ist dies auf die Nichtverfügbarkeit von Daten und Unternehmensmaßnahmen zurückzuführen. Diese Positionen unterlagen nach wie vor dem vollständigen Ausschluss-Screening von HSBC und wurden im Hinblick auf verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Prinzipien des UNGC und der OECD geprüft.

Der Teilfonds hielt Barmittel / Barmitteläquivalente (der Prozentsatz der gehaltenen Barmittel ist in der obigen Tabelle der Sektoren/Teilsektoren unter der Überschrift „In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?“ ersichtlich) zum Zwecke des Liquiditätsmanagements sowie derivative Finanzinstrumente zum Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements. Barmittel / Barmitteläquivalente und derivative Finanzinstrumente verfügen aufgrund der Art dieser Instrumente über keinen ökologischen oder sozialen Mindestschutz.



### **Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?**

Im Laufe des Berichtszeitraums schloss der Anlageberater unter anderem verbotene Waffen, umstrittene Waffen, Unternehmen, die mehr als 10 % ihres Umsatzes aus Kraftwerkskohle und Energieerzeugung aus Kohle generieren, und Tabakherstellung aus und investierte in Unternehmen mit verantwortungsvollen Geschäftspraktiken gemäß den Prinzipien des UNGC.

Alle Positionen des Portfolios wurden hinsichtlich ihrer individuellen Treibhausgasintensität bewertet. Der Teilfonds bewertete auch ESG-Scores mit dem Ergebnis, dass der ESG-Score während des gesamten Berichtszeitraums vergleichbar mit dem des Referenzwerts war.

Darüber hinaus wurden alle Positionen auf Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der OECD untersucht, um Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung innerhalb des Portfolios sicherzustellen.



### **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

#### **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Nicht zutreffend.

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?***  
Nicht zutreffend.
- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?***  
Nicht zutreffend.
- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?***  
Nicht zutreffend.

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen 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.

Name des Produkts: HSBC GLOBAL INVESTMENT FUNDS - GLOBAL HIGH YIELD SECURITISED CREDIT BOND

Unternehmenskennung (LEI-Code): 213800198CU86I7VMN23

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

| <input checked="" type="checkbox"/> <input checked="" type="checkbox"/> <input type="checkbox"/> <b>Ja</b>  | <input checked="" type="checkbox"/> <input type="checkbox"/> <input checked="" type="checkbox"/> <b>Nein</b>   |
|---|--|
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel</b> getätigt: _ %<br><br><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><br><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><br><input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel</b> getätigt: _ % | <input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit <b>ökologische/soziale Merkmale beworben</b> und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 0,03 % an nachhaltigen Investitionen<br><br><input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><br><input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><br><input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel<br><br><input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine <b>nachhaltigen Investitionen getätigt</b> |



### Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Während des Geschäftsjahres zum 31. März 2024 (der Bezugszeitraum) bewarb der Teilfonds die folgenden Merkmale:

- Der Teilfonds investierte in Wertpapiere, die Klimaschutz- oder umweltschutzbezogene Projekte unterstützten.
- Der Teilfonds berücksichtigte verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Grundsätzen des Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC) und den Leitsätzen für multinationale Unternehmen der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für Unternehmen. Wurden potenzielle Verstöße gegen die Prinzipien des UNGC festgestellt, wurden die Emittenten einer eigenen Due-Diligence-Prüfung hinsichtlich ESG-Themen unterzogen, um festzustellen, ob sie für die Aufnahme in das Portfolio des Teilfonds geeignet sind, und sie auszuschließen, falls sie als ungeeignet erachtet wurden.
- Der Teilfonds schloss Geschäftstätigkeiten aus, die als umweltschädlich gelten, wie z. B. die Förderung von Kraftwerkskohle und die Kohleverstromung.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.



4. Der Teilfonds prüfte und analysierte alle Unternehmen oder Emittenten im Hinblick auf ökologische Merkmale, insbesondere physische Risiken durch den Klimawandel und Personalmanagement.
5. Der Teilfonds berücksichtigte aktiv ökologische und soziale Aspekte, indem er über unsere Engagement- und Stewardship-Teams Mitwirkung bei Emittenten umsetzte, wo HSBC Asset Management dies für angemessen hielt.
6. Der Teilfonds schloss nach entsprechender Analyse Anlagen in umstrittenen Waffen aus.

Die auf ESG und Nachhaltigkeitsindikatoren bezogenen Scores werden anhand der proprietären Methodik von HSBC Asset Management und externer ESG-Datenanbieter berechnet. Wir verwenden ESG-Scores von Drittanbietern (z. B. ESG-Scores von MSCI) und haben auch eigene Scores entwickelt, um unsere eigene Sicht der ESG-Risiken und -Chancen widerzuspiegeln. Wir haben eine maßgeschneiderte Branchensegmentierung entwickelt (abgeleitet vom MSCI Global Industry Classification Standard), bei der wir die Wesentlichkeit der wichtigsten E-, S- und G-Faktoren von MSCI auf einer sektoralen Basis neu bewerten und eine sektorspezifische HSBC-ESG-Gewichtung erstellen.

Die Berücksichtigung einzelner wichtigster nachteiliger Auswirkungen (PAI) wird in der nachstehenden Tabelle anhand ihrer Nummerierung im Vergleich zum Referenzwert angegeben. Die bei der Berechnung der PAI-Werte verwendeten Daten stammen von externen Datenanbietern. Sie können auf Unternehmens-/Emittentenangaben basieren oder von den Datenanbietern geschätzt werden, wo keine solchen Angaben vorliegen. Bitte beachten Sie, dass es nicht immer möglich ist, die Richtigkeit, Aktualität oder Vollständigkeit der von Drittanbietern bereitgestellten Daten zu garantieren. Der Referenzwert wurde für den Marktvergleich herangezogen, diente aber nicht der Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale des Teilfonds.

Das Abschneiden der Nachhaltigkeitsindikatoren, die der Teilfonds zur Messung der Erreichung der von ihm beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet, ist in der folgenden Tabelle dargestellt. Es wurde auf das Erreichen eines ESG-Score des Teilfonds hingearbeitet, der über dem vom Teilfonds ausgewählten Referenzindex liegt (ein höherer Score als der Referenzwert bedeutet bessere ESG-Referenzen).

Alle Unternehmen/Emittenten haben eine gute Unternehmensführung bewiesen, was sich am PAI-Score 10 unten ablesen lässt.

### **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

| <b>Indikator</b>   | <b>Teilfonds</b> |
|--|------------------|
| ESG-Score  | 5,28             |
| E-Säule  | 6,95             |
| S-Säule  | 4,61             |
| G-Säule  | 4,70             |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 0,00 %           |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 0,00 %           |

Die Daten in diesem regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung beziehen sich auf den Stand vom 31. März 2024, basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des am 31. März 2024 endenden Geschäftsjahres.

### **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

| <b>Indikator</b>   | <b>Zeitraum zum</b> | <b>Teilfonds</b> |
|--|---------------------|------------------|
| ESG-Score  | 31. März 2024       | 5,28             |
|  | 31. März 2023       | 7,10             |
| E-Säule  | 31. März 2024       | 6,95             |
|  | 31. März 2023       | 6,48             |
| S-Säule  | 31. März 2024       | 4,61             |
|  | 31. März 2023       | 5,01             |
| G-Säule  | 31. März 2024       | 4,70             |
|  | 31. März 2023       | 5,55             |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 31. März 2024       | 0,00 %           |
|  | 31. März 2023       | 0,00 %           |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 31. März 2024       | 0,00 %           |
|  | 31. März 2023       | 0,00 %           |

Da es sich erst um den zweiten regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung handelt, ist kein Vergleich mit vorangegangenen Zeiträumen möglich.

### **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die vom Teilfonds getätigten nachhaltigen Investitionen trugen unter anderem zu folgenden ökologischen Zielen bei:

1. Reduzierung von Treibhausgasemissionen und Verringerung des CO<sub>2</sub>-Fußabdrucks;
2. Übergang zu oder die Nutzung von erneuerbarer Energie.

Der Teilfonds identifizierte und analysierte ESG-Referenzen eines Unternehmens als wesentlichen Bestandteil des Anlageentscheidungsprozesses für die Portfoliokonstruktion mit dem Ziel, Nachhaltigkeitsrisiken zu reduzieren und Renditen zu steigern. Der Anlageberater zielt darauf ab, durch Berücksichtigung der ESG-Referenzen potenzieller Investitionen einen besseren ESG-Score zu erzielen als der Referenzwert.

### **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Wir bestätigen, dass wir nachhaltige Vermögenswerte darauf geprüft haben, ob sie erhebliche Beeinträchtigungen verursachen können. Dies erfolgte im Rahmen des Standard-Anlageprozesses von HSBC Asset Management (HSBC) und unter Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen.

*Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?*

Der Anlageberater hat alle durch die Offenlegungsverordnung definierten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI) auf ihre Relevanz für den Teilfonds geprüft. Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren legt fest, wie HSBC die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen identifiziert und darauf reagiert, und in welcher Form HSBC Nachhaltigkeitsrisiken berücksichtigt, die sich negativ auf Wertpapiere auswirken können, in die der Teilfonds investiert. HSBC identifizierte in Zusammenarbeit mit externen Screening-Dienstleistern wie Sustainalytics, ISS, MSCI und Trucost Unternehmen und Staaten mit schlechter Bilanz beim Management von ESG-Risiken, und wo solche wesentlichen Risiken

identifiziert wurden, führte HSBC zusätzliche Due Diligence-Prüfungen durch. Durch Screening identifizierte Nachhaltigkeitsauswirkungen, einschließlich der relevanten PAI, bildeten einen Schlüsselfaktor beim Anlageentscheidungsprozess.

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 oben beschriebene Ansatz führte dazu, dass unter anderem folgende Faktoren geprüft wurden:

- Engagement der Unternehmen für den Übergang zu CO<sub>2</sub>-armen Wirtschaften, zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern, Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus großen Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails; und
  - Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit folgenden Bereichen: demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.
- Die spezifischen PAI für diesen Teilfonds waren wie unten beschrieben.

Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren ist auf der Website <http://www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies> verfügbar.

*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:*

HSBC hat sich der Anwendung und Förderung globaler Standards verpflichtet. Die wichtigsten Schwerpunktbereiche der Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren entsprachen den zehn UNGC-Grundsätzen. Diese Grundsätze stehen in Zusammenhang mit nicht finanziellen Risiken in den Bereichen Menschenrechte, Arbeit, Umweltschutz und Korruptionsbekämpfung. HSBC gehört darüber hinaus zu den Unterzeichnern der UN Principles for Responsible Investment. Diese bildeten den Rahmen für Ermittlung und Management von Nachhaltigkeitsrisiken beim Investmentansatz von HSBC. Von Unternehmen, in die der Teilfonds investierte, wurde erwartet, dass sie die Anforderungen des UNGC und der damit verbundenen Standards erfüllen. Unternehmen, die belegbar gegen einen der zehn Grundsätze des UNGC verstießen, wurden systematisch ausgeschlossen. Der Teilfonds führte verstärkte Due-Diligence-Prüfungen bei Unternehmen durch, die als nicht konform mit den Prinzipien des UNGC angesehen wurden oder die nach den unternehmenseigenen ESG Ratings von HSBC als risikoreich angesehen wurden. Darüber hinaus wurden die Unternehmen nach internationalen Standards wie den OECD-Leitsätzen bewertet.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen. Hierbei gelten spezifische von der Union definierte Kriterien.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*



## Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die vom Teilfonds berücksichtigte wichtigste nachteilige Auswirkungen waren:

- Treibhausgasintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1 und Scope 2)
- Verstöße gegen die UNGC- und OECD-Grundsätze
- Anteil der Investitionen mit Beteiligung an umstrittenen Waffen

Der Ansatz zur Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen beinhaltete unter anderem, dass HSBC das Engagement der Unternehmen für den Übergang zu kohlenstoffarmem Wirtschaften, die zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern sowie die Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette prüfte, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails. Ebenfalls berücksichtigt wurde das Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit den Bereichen demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.

Das Screening führte dazu, dass HSBC nicht in bestimmte Unternehmen und Emittenten investierte.



## Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der Investitionen** entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden: basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des Bezugszeitraums zum 31.03.2024

| Größte Investitionen                | Sektor | % der Vermögenswerte | Land  |
|-------------------------------------|--------|----------------------|---|
| HSBC GLF-USD ESG LIQ-Y 11315951     | Andere | 2,74 %               | Irland  |
| APID 2023-43A E 11399756            | Andere | 2,71 %               | Jersey  |
| PROG 2021-SFR4 F 10898308           | Andere | 2,35 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| MSC 2021-230P E 11063884            | Andere | 2,30 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| BCORE 2019-CORE E 10902182          | Andere | 2,29 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| BX 2019-CALM E 10532153             | Andere | 2,28 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| GILBT 2017-1A E 10397433            | Andere | 2,08 %               | Kaimaninseln  |
| PIPK 2023-12A E 11380675            | Andere | 2,08 %               | Jersey  |
| LMILE 2021-1X E 10871290            | Andere | 2,03 %               | Irland  |
| STACR 2021-DNA3 M2 11379197         | Andere | 1,97 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| MDPK 2015-17A ER 10120182           | Andere | 1,96 %               | Kaimaninseln  |
| KNDL 2019-KNSQ E 10665183           | Andere | 1,67 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| APID 2017-27A D 11367593            | Andere | 1,63 %               | Kaimaninseln  |
| Taurus 2021-1 Uk Dac Frn 17.05.2031 | Andere | 1,60 %               | Irland  |
| PLRS 2021-1 C 11381576              | Andere | 1,54 %               | Vereinigtes Königreich von Großbritannien und Nordirland. |

Barmittel und Derivate wurden nicht berücksichtigt

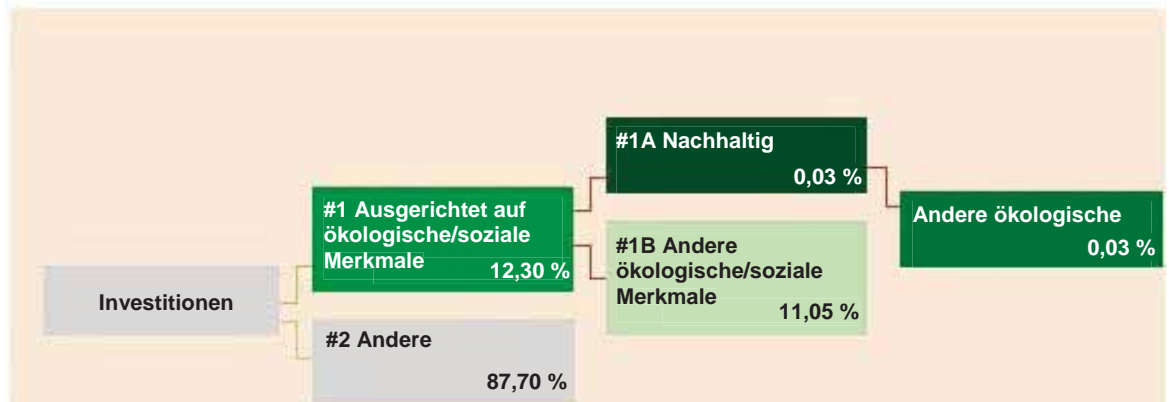


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

0,03 % des Portfolios waren in nachhaltige Vermögenswerte investiert.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?



**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**#2 Andere Investitionen** umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:  
 - Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.  
 - Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

### In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

| Sektor / Teilsektor    | % der Vermögenswerte |
|------------------------|----------------------|
| Andere                 | 83,24 %              |
| Finanzen               | 12,57 %              |
| Barmittel und Derivate | 1,92 %               |
| Basiskonsumgüter       | 1,51 %               |
| Immobilien             | 0,67 %               |
| Staatsanleihen         | 0,08 %               |
| Summe                  | 100,00 %             |



## Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

Der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen lag bei 0 %. Der Teilfonds hat sich nicht verpflichtet, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen.

### Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

Ja:

In fossiles Gas       In Kernenergie

Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

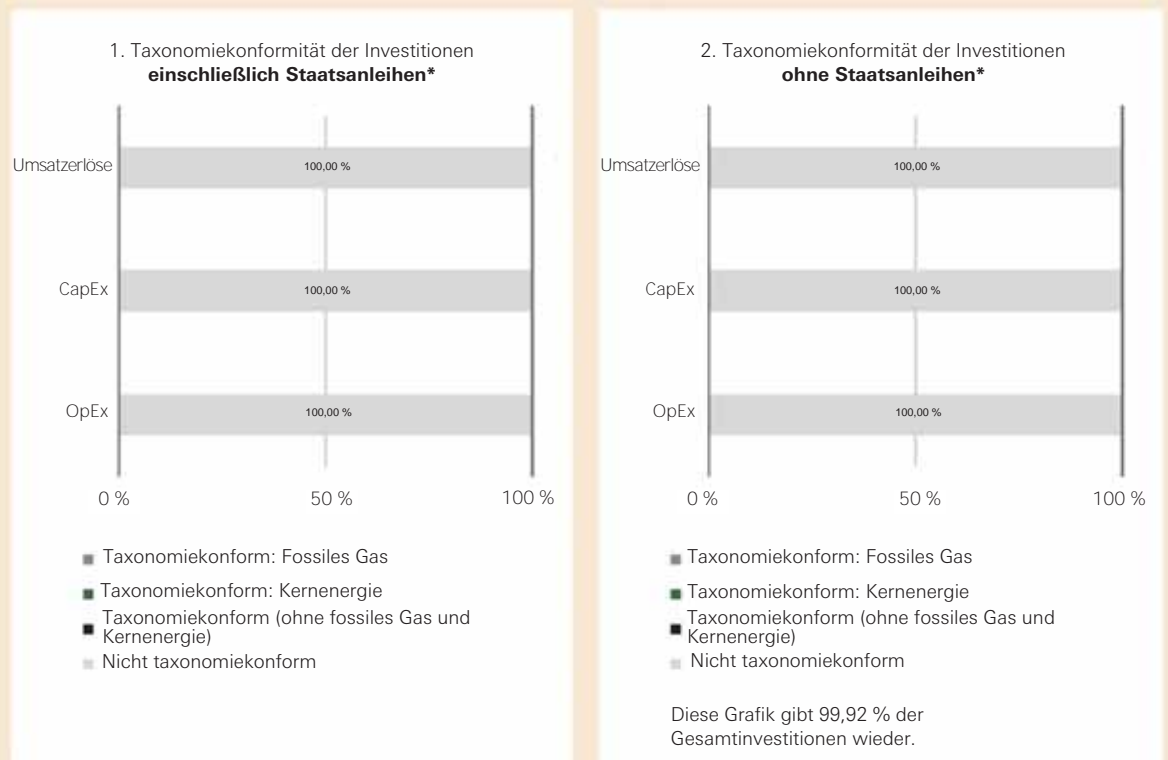
- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen

- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

**Übergangstätigkeiten** sind Wirtschaftstätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

**Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.**



\* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

### Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?


Im Referenzzeitraum betrug der Anteil der Investitionen des Fonds, die in Übergangstätigkeiten geflossen sind, 0,00 % und der Anteil der Investitionen, die in ermöglichende Tätigkeiten geflossen ist, 0,00 %.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

| Indikator   | 2023-2024 | 2022-2023 |
|---|-----------|-----------|
| Umsatz – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                       | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform: Kernenergie                        | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie) | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Nicht taxonomiekonform                               | 100,00 %  | 100,00 %  |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                        | n. z.     | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                         | n. z.     | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)  | n. z.     | 0,00 %    |
| CAPEX – Nicht taxonomiekonform                                | 100,00 %  | 100,00 %  |
| OPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                         | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                          | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)   | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Nicht taxonomiekonform                                 | 100,00 %  | 100,00 %  |

Da es sich erst um den zweiten Berichtszeitraum des Teilfonds handelt, ist ein Vergleich mit der Zeit davor nicht erforderlich.

 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?**

Die nachhaltigen Investitionen mit einem nicht mit der EU-Taxonomie konformen Umweltziel betragen 0,03 %. Der Teilfonds hat sich nicht verpflichtet, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen.

 **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Teilfonds investierte nicht in sozial nachhaltige Anlagen.

 **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

#2 Andere Investitionen umfasst die Finanzinstrumente, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden. In manchen Fällen ist dies auf die Nichtverfügbarkeit von Daten und Unternehmensmaßnahmen zurückzuführen. Diese Positionen unterlagen nach wie vor dem vollständigen Ausschluss-Screening von HSBC und wurden im Hinblick auf verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Prinzipien des UNGC und der OECD geprüft.

Der Teilfonds hielt Barmittel / Barmitteläquivalente (der Prozentsatz der gehaltenen Barmittel ist in der obigen Tabelle der Sektoren/Teilektoren unter der Überschrift „In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?“ ersichtlich) zum Zwecke des Liquiditätsmanagements sowie derivative Finanzinstrumente zum Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements. Barmittel / Barmitteläquivalente und derivative Finanzinstrumente verfügen aufgrund der Art dieser Instrumente über keinen ökologischen oder sozialen Mindestschutz.



## Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Im Laufe des Berichtszeitraums schloss der Anlageberater unter anderem verbotene Waffen, umstrittene Waffen, Unternehmen, die mehr als 10 % ihres Umsatzes aus Kraftwerkskohle und Energieerzeugung aus Kohle generieren, und Tabakherstellung aus und investierte in Unternehmen mit verantwortungsvollen Geschäftspraktiken gemäß den Prinzipien des UNGC.

Nach der Identifizierung des zulässigen Anlageuniversums konstruierte der Anlageberater ein Portfolio, dessen CO<sub>2</sub>-Intensität (berechnet als gewichteter Durchschnitt der CO<sub>2</sub>-Intensitäten der Anlagen des Teilfonds) niedriger ist als der gewichtete Durchschnitt der Bestandteile des Referenzwerts. Dies führte zu einem PAI-Score, der unter dem Referenzwert lag. Der Teilfonds bewertete auch ESG-Scores mit dem Ergebnis, dass der ESG-Score während des gesamten Berichtszeitraums über dem des Referenzwerts lag.

Darüber hinaus wurden alle Positionen auf Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der OECD untersucht, um Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung innerhalb des Portfolios sicherzustellen.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend.

### ● **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Nicht zutreffend.

### ● **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?**

Nicht zutreffend.

### ● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

### ● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.



Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen 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.

**Name des Produkts:** HSBC GLOBAL INVESTMENT FUNDS - GLOBAL INFLATION LINKED BOND

**Unternehmenskennung (LEI-Code):** 549300GR296YJ5DZ9M61

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

| <input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> <input type="checkbox"/> <b>Ja</b>  | <input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> <b>Nein</b>   |
|---|--|
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel</b> getätigt: _ %<br><br><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><br><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><br><input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel</b> getätigt: _ % | <input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit <b>ökologische/soziale Merkmale beworben</b> und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 1,69 % an nachhaltigen Investitionen<br><br><input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><br><input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><br><input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel<br><br><input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine <b>nachhaltigen Investitionen getätigt</b> . |



### Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Während des Geschäftsjahres zum 31. März 2024 (der Bezugszeitraum) bewarb der Teilfonds die folgenden Merkmale:

- Der Teilfonds investierte in Wertpapiere, die Klimaschutz- oder umweltschutzbezogene Projekte unterstützten.
- Der Teilfonds berücksichtigte verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Grundsätzen des Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC) und den Leitsätzen für multinationale Unternehmen der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für Unternehmen. Wurden potenzielle Verstöße gegen die Prinzipien des UNGC festgestellt, wurden die Emittenten einer eigenen Due-Diligence-Prüfung hinsichtlich ESG-Themen unterzogen, um festzustellen, ob sie für die Aufnahme in das Portfolio des Teilfonds geeignet sind, und sie auszuschließen, falls sie als ungeeignet erachtet wurden.
- Der Teilfonds schloss Geschäftstätigkeiten aus, die als umweltschädlich gelten, wie z. B. die Förderung von Kraftwerkskohle und die Kohleverstromung.

4. Der Teilfonds prüfte und analysierte alle Unternehmen oder Emittenten im Hinblick auf ökologische Merkmale, insbesondere physische Risiken durch den Klimawandel und Personalmanagement.
5. Der Teilfonds berücksichtigte aktiv ökologische und soziale Aspekte, indem er über unsere Engagement- und Stewardship-Teams Mitwirkung bei Emittenten umsetzte, wo HSBC Asset Management dies für angemessen hielt.
6. Der Teilfonds schloss nach entsprechender Analyse Anlagen in umstrittenen Waffen aus.

Die auf ESG und Nachhaltigkeitsindikatoren bezogenen Scores werden anhand der proprietären Methodik von HSBC Asset Management und externer ESG-Datenanbieter berechnet. Wir verwenden ESG-Scores von Drittanbietern (z. B. ESG-Scores von MSCI) und haben auch eigene Scores entwickelt, um unsere eigene Sicht der ESG-Risiken und -Chancen widerzuspiegeln. Wir haben eine maßgeschneiderte Branchensegmentierung entwickelt (abgeleitet vom MSCI Global Industry Classification Standard), bei der wir die Wesentlichkeit der wichtigsten E-, S- und G-Faktoren von MSCI auf einer sektoralen Basis neu bewerten und eine sektorspezifische HSBC-ESG-Gewichtung erstellen.

Die Berücksichtigung einzelner wichtigster nachteiliger Auswirkungen (PAI) wird in der nachstehenden Tabelle anhand ihrer Nummerierung im Vergleich zum Referenzwert angegeben. Die bei der Berechnung der PAI-Werte verwendeten Daten stammen von externen Datenanbietern. Sie können auf Unternehmens-/Emittentenangaben basieren oder von den Datenanbietern geschätzt werden, wo keine solchen Angaben vorliegen. Bitte beachten Sie, dass es nicht immer möglich ist, die Richtigkeit, Aktualität oder Vollständigkeit der von Drittanbietern bereitgestellten Daten zu garantieren. Der Referenzwert wurde für den Marktvergleich herangezogen, diente aber nicht der Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale des Teilfonds.

Das Abschneiden der Nachhaltigkeitsindikatoren, die der Teilfonds zur Messung der Erreichung der von ihm beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet, ist in der folgenden Tabelle dargestellt. Es wurde auf das Erreichen eines ESG-Score des Teilfonds hingearbeitet, der über dem vom Teilfonds ausgewählten Referenzindex liegt (ein höherer Score als der Referenzwert bedeutet bessere ESG-Referenzen).

Alle Unternehmen/Emittenten haben eine gute Unternehmensführung bewiesen, was sich am PAI-Score 10 unten ablesen lässt.

### ● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

| <b>Indikator</b>   | <b>Teilfonds</b> | <b>Referenzwert</b> |
|--|------------------|---------------------|
| ESG-Score  | 6,48             | 6,17                |
| E-Säule  | 6,05             | 5,96                |
| S-Säule  | 7,36             | 7,27                |
| G-Säule  | 7,27             | 6,99                |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente pro Million Euro Umsatz   | 4,27             | 0,00                |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 0,01 %           | 0,00 %              |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 0,00 %           | 0,00 %              |
| 15. THG-Emissionsintensität - Kennzahl in Kilotonnen pro BIP-Einheit (in Millionen Euro)   | 310,70           | 307,87              |

Die Daten in diesem regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung beziehen sich auf den Stand vom 31. März 2024, basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des am 31. März 2024 endenden Geschäftsjahres.

Referenzwert – ICE BofA Global Governments – Inflation-Linked

### ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

| Indikator  | Zeitraum zum  | Teilfonds | Referenzwert |
|--|---------------|-----------|--------------|
| ESG-Score  | 31. März 2024 | 6,48      | 6,17         |
|  | 31. März 2023 | 6,27      | 5,90         |
| E-Säule  | 31. März 2024 | 6,05      | 5,96         |
|  | 31. März 2023 | 4,93      | 4,98         |
| S-Säule  | 31. März 2024 | 7,36      | 7,27         |
|  | 31. März 2023 | 7,39      | 7,25         |
| G-Säule  | 31. März 2024 | 7,27      | 6,99         |
|  | 31. März 2023 | 6,76      | 6,21         |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente pro Million Euro Umsatz   | 31. März 2024 | 4,27      | 0,00         |
|  | 31. März 2023 | 5,55      | 0,00         |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 31. März 2024 | 0,01 %    | 0,00 %       |
|  | 31. März 2023 | 0,00 %    | 0,00 %       |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 31. März 2024 | 0,00 %    | 0,00 %       |
|  | 31. März 2023 | 0,00 %    | 0,00 %       |
| 15. THG-Emissionsintensität - Kennzahl in Kilotonnen pro BIP-Einheit (in Millionen Euro)   | 31. März 2024 | 310,70    | 307,87       |
|  | 31. März 2023 | 218,08    | 230,97       |

Da es sich erst um den zweiten regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung handelt, ist kein Vergleich mit vorangegangenen Zeiträumen möglich.

### **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die vom Teilfonds getätigten nachhaltigen Investitionen trugen unter anderem zu folgenden ökologischen Zielen bei:

1. Reduzierung von Treibhausgasemissionen und Verringerung des CO<sub>2</sub>-Fußabdrucks;
2. Übergang zu oder die Nutzung von erneuerbarer Energie.

Der Teilfonds identifizierte und analysierte ESG-Referenzen eines Unternehmens als wesentlichen Bestandteil des Anlageentscheidungsprozesses für die Portfoliokonstruktion mit dem Ziel, Nachhaltigkeitsrisiken zu reduzieren und Renditen zu steigern. Der Anlageberater zielt darauf ab, durch Berücksichtigung der ESG-Referenzen potenzieller Investitionen einen besseren ESG-Score zu erzielen als der Referenzwert.

### **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Wir bestätigen, dass wir nachhaltige Vermögenswerte darauf geprüft haben, ob sie erhebliche Beeinträchtigungen verursachen können. Dies erfolgte im Rahmen des Standard-Anlageprozesses von HSBC Asset Management (HSBC) und unter Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen.

*Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?*

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 Anlageberater hat alle durch die Offenlegungsverordnung definierten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI) auf ihre Relevanz für den Teilfonds geprüft. Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren legt fest, wie HSBC die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen identifiziert und darauf reagiert, und in welcher Form HSBC Nachhaltigkeitsrisiken berücksichtigt, die sich negativ auf Wertpapiere auswirken können, in die der Teilfonds investiert. HSBC identifizierte in Zusammenarbeit mit externen Screening-Dienstleistern wie Sustainalytics, ISS, MSCI und Trucost Unternehmen und Staaten mit schlechter Bilanz beim Management von ESG-Risiken, und wo solche wesentlichen Risiken identifiziert wurden, führte HSBC zusätzliche Due Diligence-Prüfungen durch. Durch Screening identifizierte Nachhaltigkeitsauswirkungen, einschließlich der relevanten PAI, bildeten einen Schlüsselfaktor beim Anlageentscheidungsprozess.

Der oben beschriebene Ansatz führte dazu, dass unter anderem folgende Faktoren geprüft wurden:

- Engagement der Unternehmen für den Übergang zu CO<sub>2</sub>-armen Wirtschaften, zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern, Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus großen Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails.
- Ebenfalls berücksichtigt wurde das Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit den Bereichen demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.

Die spezifischen PAI für diesen Teilfonds waren wie unten beschrieben.

Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren ist auf der Website [www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies](http://www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies) verfügbar.

*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:*

HSBC hat sich der Anwendung und Förderung globaler Standards verpflichtet. Die wichtigsten Schwerpunktbereiche der Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren entsprachen den zehn UNGC-Grundsätzen. Diese Grundsätze stehen in Zusammenhang mit nicht finanziellen Risiken in den Bereichen Menschenrechte, Arbeit, Umweltschutz und Korruptionsbekämpfung. HSBC gehört darüber hinaus zu den Unterzeichnern der UN Principles for Responsible Investment. Diese bildeten den Rahmen für Ermittlung und Management von Nachhaltigkeitsrisiken beim Investmentansatz von HSBC. Von Unternehmen, in die der Teilfonds investierte, wurde erwartet, dass sie die Anforderungen des UNGC und der damit verbundenen Standards erfüllen. Unternehmen, die belegbar gegen einen der zehn Grundsätze des UNGC verstießen, wurden systematisch ausgeschlossen. Der Teilfonds führte verstärkte Due-Diligence-Prüfungen bei Unternehmen durch, die als nicht konform mit den Prinzipien des UNGC angesehen wurden oder die nach den unternehmenseigenen ESG Ratings von HSBC als risikoreich angesehen wurden. Darüber hinaus wurden die Unternehmen nach internationalen Standards wie den OECD-Leitsätzen bewertet.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen. Hierbei gelten spezifische von der Union definierte Kriterien.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*



### **Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Die vom Teilfonds berücksichtigte wichtigste nachteilige Auswirkungen waren:

- Treibhausgasintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1 und Scope 2)
- Verstöße gegen die Prinzipien des UNGC und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD)
- Anteil der Investitionen mit Beteiligung an umstrittenen Waffen

Der Ansatz zur Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen beinhaltete unter anderem, dass HSBC das Engagement der Unternehmen für den Übergang zu kohlenstoffarmem Wirtschaften, die zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern sowie die Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette prüfte, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails. Ebenfalls berücksichtigt wurde das Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit den Bereichen demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung. Das Screening führte dazu, dass HSBC nicht in bestimmte Unternehmen und Emittenten investierte.



## Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der Investitionen** entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden: basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des Bezugszeitraums zum 31.03.2024

| Größte Investitionen   | Sektor         | % der Vermögenswerte | Land  |
|--|----------------|----------------------|---|
| Government Of Germany 0,1 %<br>15.04.2026                        | Staatsanleihen | 6,66 %               | Deutschland   |
| Government Of The United States<br>Of America 1,125 % 15.01.2033 | Staatsanleihen | 5,67 %               | Vereinigte Staaten von<br>Amerika                               |
| Government Of The United States<br>Of America 0,5 % 15.01.2028   | Staatsanleihen | 4,60 %               | Vereinigte Staaten von<br>Amerika                               |
| Government Of The United States<br>Of America 0,375 % 15.01.2027 | Staatsanleihen | 4,17 %               | Vereinigte Staaten von<br>Amerika                               |
| Government Of United Kingdom<br>0,25 % 22.03.2052                | Staatsanleihen | 3,72 %               | Vereinigtes Königreich<br>von Großbritannien<br>und Nordirland. |
| Government Of United Kingdom<br>0,75 % 22.03.2034                | Staatsanleihen | 3,25 %               | Vereinigtes Königreich<br>von Großbritannien<br>und Nordirland. |
| Government Of The United States<br>Of America 0,125 % 15.01.2032 | Staatsanleihen | 3,17 %               | Vereinigte Staaten von<br>Amerika                               |
| Government Of The United States<br>Of America 2,5 % 15.01.2029   | Staatsanleihen | 3,05 %               | Vereinigte Staaten von<br>Amerika                               |
| Government Of Germany 0,5 %<br>15.04.2030                        | Staatsanleihen | 3,03 %               | Deutschland   |
| Government Of Italy 0,1 %<br>15.05.2033                          | Staatsanleihen | 2,74 %               | Italien   |
| Government Of United Kingdom<br>0,125 % 10.08.2031               | Staatsanleihen | 2,66 %               | Vereinigtes Königreich<br>von Großbritannien<br>und Nordirland. |
| Government Of The United States<br>Of America 0,625 % 15.01.2026 | Staatsanleihen | 2,64 %               | Vereinigte Staaten von<br>Amerika                               |
| Government Of United Kingdom<br>0,625 % 22.03.2040               | Staatsanleihen | 2,63 %               | Vereinigtes Königreich<br>von Großbritannien<br>und Nordirland. |
| Government Of New Zealand<br>3,5 % 14.04.2033                    | Staatsanleihen | 2,34 %               | Neuseeland  |

Barmittel und Derivate wurden nicht berücksichtigt

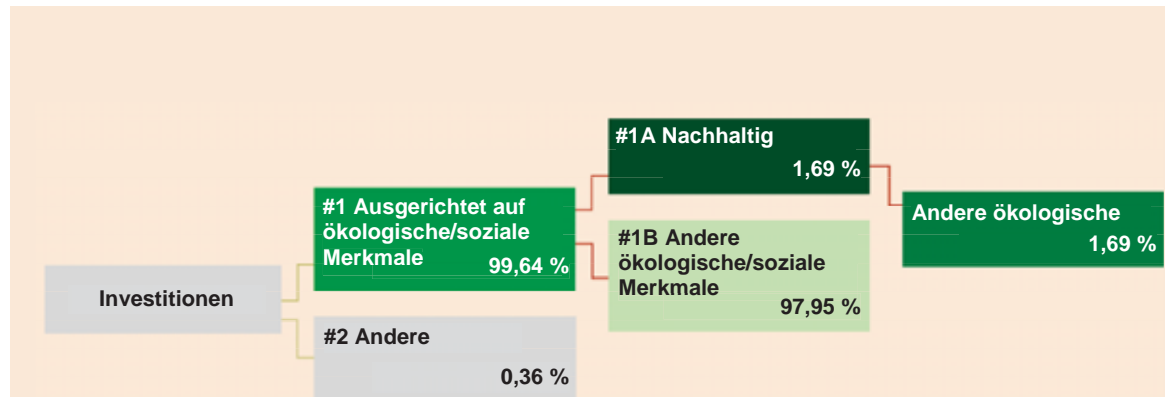


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

1,69 % des Portfolios waren in nachhaltige Vermögenswerte investiert.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?



**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**#2 Andere Investitionen** umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:  
- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.  
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

### In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

| Sektor / Teilsektor    | % der Vermögenswerte |
|------------------------|----------------------|
| Staatsanleihen         | 99,99 %              |
| Andere                 | 0,44 %               |
| Finanzen               | 0,02 %               |
| Barmittel und Derivate | -0,46 %              |
| Summe                  | 100,00 %             |

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.



### Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

Der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen lag bei 0 %. Der Teilfonds hat sich nicht verpflichtet, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen.

### Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

Ja:

In fossiles Gas  In Kernenergie

Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

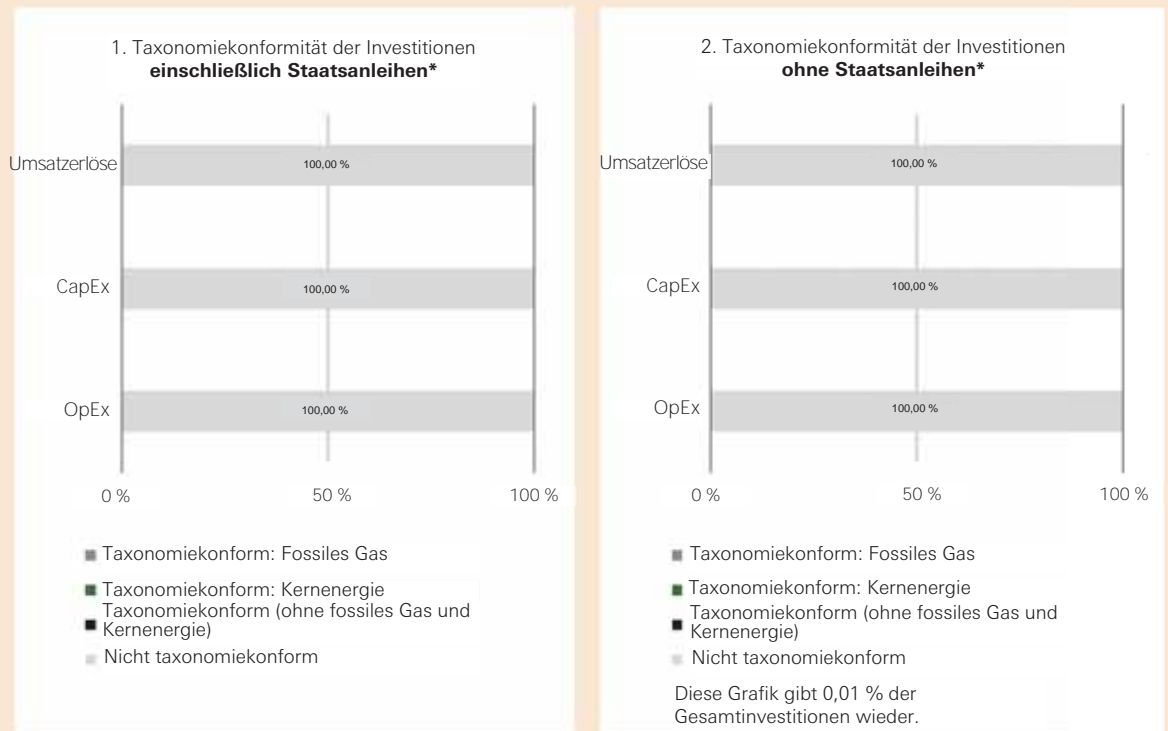
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen.

- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

**Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

**Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.**



\* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Im Referenzzeitraum betrug der Anteil der Investitionen des Fonds, die in Übergangstätigkeiten geflossen sind, 0,00 % und der Anteil der Investitionen, die in ermöglichende Tätigkeiten geflossen ist, 0,00 %.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

| Indikator   | 2023-2024 | 2022-2023 |
|---|-----------|-----------|
| Umsatz – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                       | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform: Kernenergie                        | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie) | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Nicht taxonomiekonform                               | 100,00 %  | 100,00 %  |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                        | n. z.     | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                         | n. z.     | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)  | n. z.     | 0,00 %    |
| CAPEX – Nicht taxonomiekonform                                | 100,00 %  | 100,00 %  |
| OPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                         | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                          | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)   | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Nicht taxonomiekonform                                 | 100,00 %  | 100,00 %  |

Da es sich erst um den zweiten Berichtszeitraum des Teilfonds handelt, ist ein Vergleich mit der Zeit davor nicht erforderlich.





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?**

Der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel war 1,69 %. Der Teilfonds hat sich nicht verpflichtet, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen.



### **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Teilfonds investierte nicht in sozial nachhaltige Anlagen.



### **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

#2 Andere Investitionen umfasst die Finanzinstrumente, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden. In manchen Fällen ist dies auf die Nichtverfügbarkeit von Daten und Unternehmensmaßnahmen zurückzuführen. Diese Positionen unterlagen nach wie vor dem vollständigen Ausschluss-Screening von HSBC und wurden im Hinblick auf verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Prinzipien des UNGC und der OECD geprüft.

Der Teilfonds hielt Barmittel / Barmitteläquivalente (der Prozentsatz der gehaltenen Barmittel ist in der obigen Tabelle der Sektoren/Teilsektoren unter der Überschrift „In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?“ ersichtlich) zum Zwecke des Liquiditätsmanagements sowie derivative Finanzinstrumente zum Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements. Barmittel / Barmitteläquivalente und derivative Finanzinstrumente verfügen aufgrund der Art dieser Instrumente über keinen ökologischen oder sozialen Mindestschutz.



### **Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?**

Im Laufe des Berichtszeitraums schloss der Anlageberater unter anderem verbotene Waffen, umstrittene Waffen, Unternehmen, die mehr als 10 % ihres Umsatzes aus Kraftwerkskohle und Energieerzeugung aus Kohle generieren, und Tabakherstellung aus und investierte in Unternehmen mit verantwortungsvollen Geschäftspraktiken gemäß den Prinzipien des UNGC.

Alle Positionen des Portfolios wurden hinsichtlich ihrer individuellen Treibhausgasintensität bewertet. Der Teilfonds bewertete auch ESG-Scores mit dem Ergebnis, dass der ESG-Score während des gesamten Berichtszeitraums vergleichbar mit dem des Referenzwerts war.

Darüber hinaus wurden alle Positionen auf Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der OECD untersucht, um Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung innerhalb des Portfolios sicherzustellen.



### **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

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?**  
Nicht zutreffend.
- **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?**  
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?**  
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**  
Nicht zutreffend.

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen 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.

**Name des Produkts:** HSBC GLOBAL INVESTMENT FUNDS - GLOBAL INVESTMENT GRADE SECURITISED CREDIT BOND

**Unternehmenskennung (LEI-Code):** 213800J3KJMJOBMGO530

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

| <input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> <input type="checkbox"/> <b>Ja</b>   | <input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> <b>Nein</b>  |
|--|---|
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel</b> getätigt: _ %<br><br><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><br><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit <b>ökologische/soziale Merkmale beworben</b> und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 0,02 % an nachhaltigen Investitionen<br><br><input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><br><input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><br><input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel |
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel</b> getätigt: _ %  | <input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine <b>nachhaltigen Investitionen getätigt</b>   |



### Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Während des Geschäftsjahres zum 31. März 2024 (der Bezugszeitraum) bewarb der Teilfonds die folgenden Merkmale:

- Der Teilfonds investierte in Wertpapiere, die Klimaschutz- oder umweltschutzbezogene Projekte unterstützten.
- Der Teilfonds berücksichtigte verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Grundsätzen des Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC) und den Leitsätzen für multinationale Unternehmen der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für Unternehmen. Wurden potenzielle Verstöße gegen die Prinzipien des UNGC festgestellt, wurden die Emittenten einer eigenen Due-Diligence-Prüfung hinsichtlich ESG-Themen unterzogen, um festzustellen, ob sie für die Aufnahme in das Portfolio des Teilfonds geeignet sind, und sie auszuschließen, falls sie als ungeeignet erachtet wurden.
- Der Teilfonds schloss Geschäftstätigkeiten aus, die als umweltschädlich gelten, wie z. B. die Förderung von Kraftwerkskohle und die Kohleverstromung.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

4. Der Teilfonds prüfte und analysierte alle Unternehmen oder Emittenten im Hinblick auf ökologische Merkmale, insbesondere physische Risiken durch den Klimawandel und Personalmanagement.
5. Der Teilfonds berücksichtigte aktiv ökologische und soziale Aspekte, indem er über unsere Engagement- und Stewardship-Teams Mitwirkung bei Emittenten umsetzte, wo HSBC Asset Management dies für angemessen hielt.
6. Der Teilfonds schloss nach entsprechender Analyse Anlagen in umstrittenen Waffen aus.

Die auf ESG und Nachhaltigkeitsindikatoren bezogenen Scores werden anhand der proprietären Methodik von HSBC Asset Management und externer ESG-Datenanbieter berechnet. Wir verwenden ESG-Scores von Drittanbietern (z. B. ESG-Scores von MSCI) und haben auch eigene Scores entwickelt, um unsere eigene Sicht der ESG-Risiken und -Chancen widerzuspiegeln. Wir haben eine maßgeschneiderte Branchensegmentierung entwickelt (abgeleitet vom MSCI Global Industry Classification Standard), bei der wir die Wesentlichkeit der wichtigsten E-, S- und G-Faktoren von MSCI auf einer sektoralen Basis neu bewerten und eine sektorspezifische HSBC-ESG-Gewichtung erstellen.

Die Berücksichtigung einzelner wichtigster nachteiliger Auswirkungen (PAI) wird in der nachstehenden Tabelle anhand ihrer Nummerierung im Vergleich zum Referenzwert angegeben. Die bei der Berechnung der PAI-Werte verwendeten Daten stammen von externen Datenanbietern. Sie können auf Unternehmens-/Emittentenangaben basieren oder von den Datenanbietern geschätzt werden, wo keine solchen Angaben vorliegen. Bitte beachten Sie, dass es nicht immer möglich ist, die Richtigkeit, Aktualität oder Vollständigkeit der von Drittanbietern bereitgestellten Daten zu garantieren. Der Referenzwert wurde für den Marktvergleich herangezogen, diente aber nicht der Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale des Teilfonds.

Das Abschneiden der Nachhaltigkeitsindikatoren, die der Teilfonds zur Messung der Erreichung der von ihm beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet, ist in der folgenden Tabelle dargestellt. Es wurde auf das Erreichen eines ESG-Score des Teilfonds hingearbeitet, der über dem vom Teilfonds ausgewählten Referenzindex liegt (ein höherer Score als der Referenzwert bedeutet bessere ESG-Referenzen).

Alle Unternehmen/Emittenten haben eine gute Unternehmensführung bewiesen, was sich am PAI-Score 10 unten ablesen lässt.

### **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

| <b>Indikator</b>   | <b>Teilfonds</b> |
|--|------------------|
| ESG-Score  | 6,25             |
| E-Säule  | 7,65             |
| S-Säule  | 5,08             |
| G-Säule  | 5,65             |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 0,00 %           |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 0,00 %           |

Die Daten in diesem regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung beziehen sich auf den Stand vom 31. März 2024, basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des am 31. März 2024 endenden Geschäftsjahres.

### ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

| Indikator  | Zeitraum zum  | Teilfonds |
|--|---------------|-----------|
| ESG-Score  | 31. März 2024 | 6,25      |
|  | 31. März 2023 | 7,81      |
| E-Säule  | 31. März 2024 | 7,65      |
|  | 31. März 2023 | 8,01      |
| S-Säule  | 31. März 2024 | 5,08      |
|  | 31. März 2023 | 5,48      |
| G-Säule  | 31. März 2024 | 5,65      |
|  | 31. März 2023 | 6,42      |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 31. März 2024 | 0,00 %    |
|  | 31. März 2023 | 0,00 %    |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 31. März 2024 | 0,00 %    |
|  | 31. März 2023 | 0,00 %    |

Da es sich erst um den zweiten regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung handelt, ist kein Vergleich mit vorangegangenen Zeiträumen möglich.

### **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die vom Teilfonds getätigten nachhaltigen Investitionen trugen unter anderem zu folgenden ökologischen Zielen bei:

1. Reduzierung von Treibhausgasemissionen und Verringerung des CO<sub>2</sub>-Fußabdrucks;
2. Übergang zu oder die Nutzung von erneuerbarer Energie.

Der Teilfonds identifizierte und analysierte ESG-Referenzen eines Unternehmens als wesentlichen Bestandteil des Anlageentscheidungsprozesses für die Portfoliokonstruktion mit dem Ziel, Nachhaltigkeitsrisiken zu reduzieren und Renditen zu steigern. Der Anlageberater zielt darauf ab, durch Berücksichtigung der ESG-Referenzen potenzieller Investitionen einen besseren ESG-Score zu erzielen als der Referenzwert.

### **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Wir bestätigen, dass wir nachhaltige Vermögenswerte darauf geprüft haben, ob sie erhebliche Beeinträchtigungen verursachen können. Dies erfolgte im Rahmen des Standard-Anlageprozesses von HSBC Asset Management (HSBC) und unter Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen.

*Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?*

Der Anlageberater hat alle durch die Offenlegungsverordnung definierten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI) auf ihre Relevanz für den Teilfonds geprüft. Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren legt fest, wie HSBC die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen identifiziert und darauf reagiert, und in welcher Form HSBC Nachhaltigkeitsrisiken berücksichtigt, die sich negativ auf Wertpapiere auswirken können, in die der Teilfonds investiert. HSBC identifizierte in Zusammenarbeit mit externen Screening-Dienstleistern wie Sustainalytics, ISS, MSCI und Trucost Unternehmen und Staaten mit schlechter

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.

Bilanz beim Management von ESG-Risiken, und wo solche wesentlichen Risiken identifiziert wurden, führte HSBC zusätzliche Due Diligence-Prüfungen durch. Durch Screening identifizierte Nachhaltigkeitsauswirkungen, einschließlich der relevanten PAI, bildeten einen Schlüsselfaktor beim Anlageentscheidungsprozess. Der oben beschriebene Ansatz führte dazu, dass unter anderem folgende Faktoren geprüft wurden:

- Engagement der Unternehmen für den Übergang zu CO2-armen Wirtschaften, zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern, Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus großen Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails; und
- Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit folgenden Bereichen: demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.

Die spezifischen PAI für diesen Teilfonds waren wie unten beschrieben.

Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren ist auf der Website [www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies](http://www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies) verfügbar.

*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:*

HSBC hat sich der Anwendung und Förderung globaler Standards verpflichtet. Die wichtigsten Schwerpunktbereiche der Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren entsprachen den zehn UNGC-Grundsätzen. Diese Grundsätze stehen in Zusammenhang mit nicht finanziellen Risiken in den Bereichen Menschenrechte, Arbeit, Umweltschutz und Korruptionsbekämpfung. HSBC gehört darüber hinaus zu den Unterzeichnern der UN Principles for Responsible Investment. Diese bildeten den Rahmen für Ermittlung und Management von Nachhaltigkeitsrisiken beim Investmentansatz von HSBC. Von Unternehmen, in die der Teilfonds investierte, wurde erwartet, dass sie die Anforderungen des UNGC und der damit verbundenen Standards erfüllen. Unternehmen, die belegbar gegen einen der zehn Grundsätze des UNGC verstießen, wurden systematisch ausgeschlossen. Der Teilfonds führte verstärkte Due-Diligence-Prüfungen bei Unternehmen durch, die als nicht konform mit den Prinzipien des UNGC angesehen wurden oder die nach den unternehmenseigenen ESG Ratings von HSBC als risikoreich angesehen wurden. Darüber hinaus wurden die Unternehmen nach internationalen Standards wie den OECD-Leitsätzen bewertet.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen. Hierbei gelten spezifische von der Union definierte Kriterien.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*



## Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die vom Teilfonds berücksichtigte wichtigste nachteilige Auswirkungen waren:

- Treibhausgasintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1 und Scope 2)
- Verstöße gegen die UNGC- und OECD-Grundsätze
- Anteil der Investitionen mit Beteiligung an umstrittenen Waffen

Der Ansatz zur Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen beinhaltete unter anderem, dass HSBC das Engagement der Unternehmen für den Übergang zu kohlenstoffarmem Wirtschaften, die zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern sowie die Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette prüfte, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails. Ebenfalls berücksichtigt wurde das Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit den Bereichen demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.

Das Screening führte dazu, dass HSBC nicht in bestimmte Unternehmen und Emittenten investierte.



## Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der Investitionen** entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden: basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des Bezugszeitraums zum 31.03.2024

| Größte Investitionen  | Sektor   | % der Vermögenswerte | Land  |
|---|----------|----------------------|---|
| HSBC GLF-USD ESG LIQ-Y 11315951                             | Andere   | 3,67 %               | Irland  |
| MEDL 2023-2 A 11586968                                      | Andere   | 1,31 %               | Australien  |
| Polaris 2023-2 Plc Frn 27.09.2059                           | Finanzen | 1,27 %               | Vereinigtes Königreich von Großbritannien und Nordirland. |
| BAYPK 2023-1A A1 11591312                                   | Andere   | 1,20 %               | Jersey  |
| Ginkgo Personal Loans 2023 @na @na                          | Finanzen | 1,03 %               | Frankreich  |
| JUBIL 2023-27X A 11557727                                   | Andere   | 1,00 %               | Irland  |
| APID 2019-31A A2R 10891815                                  | Andere   | 0,98 %               | Kaimaninseln  |
| WILPA 1X A 11578162   | Andere   | 0,98 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| DBGS 2018-BIOD B 10305398                                   | Andere   | 0,89 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| JUBIL 2023-27X B 11557724                                   | Andere   | 0,89 %               | Irland  |
| CAMB 2019-LIFE C 10387050                                   | Andere   | 0,88 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| AGL 2023-28A A 11597275                                     | Andere   | 0,86 %               | Jersey  |
| Slm Private Credit Student Loan Trust 2006-a @na 15.06.2039 | Finanzen | 0,85 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| Bx Trust 2022-clc 5,76 % 14.10.2039                         | Andere   | 0,82 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| TAURS 2021-UK1X A 10829990                                  | Andere   | 0,79 %               | Irland  |

Barmittel und Derivate wurden nicht berücksichtigt

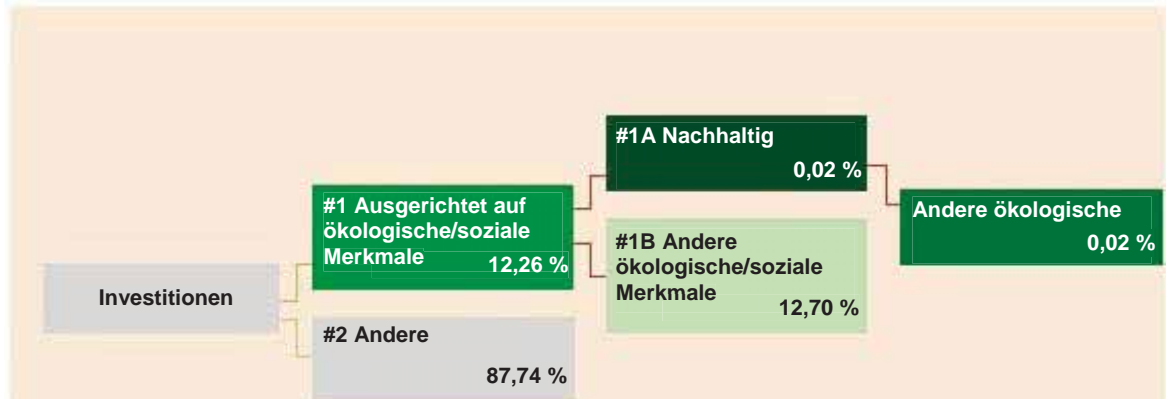


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

0,02 % des Portfolios waren in nachhaltige Vermögenswerte investiert.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?



**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**#2 Andere Investitionen** umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:  
 - Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.  
 - Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

### In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

| Sektor / Teilsektor            | % der Vermögenswerte |
|--------------------------------|----------------------|
| Andere                         | 74,61 %              |
| Finanzen                       | 25,03 %              |
| Immobilien                     | 0,69 %               |
| Kommunikationsdienstleistungen | 0,56 %               |
| Staatsanleihen                 | 0,08 %               |
| Barmittel und Derivate         | -0,96 %              |
| Summe                          | 100,00 %             |





Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

## Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

Der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen lag bei 0 %. Der Teilfonds hat sich nicht verpflichtet, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen.

### Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

Ja:  In fossiles Gas  In Kernenergie

Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

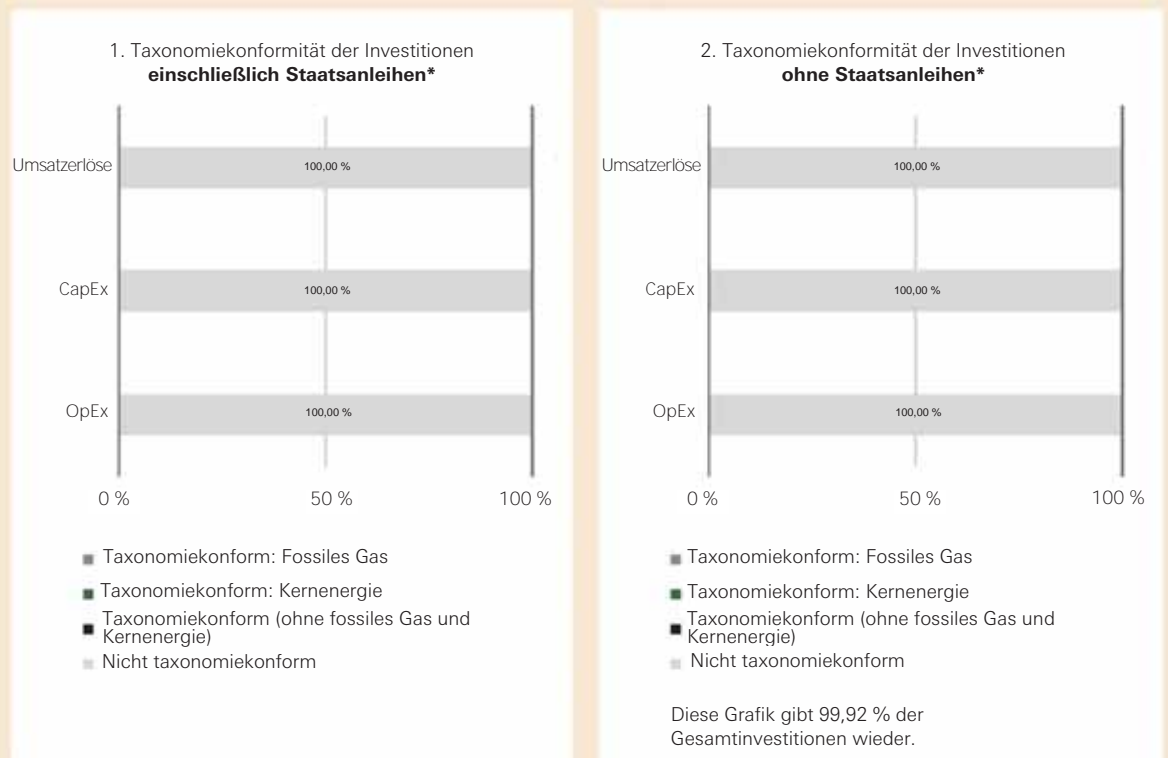
- Umsatzerlöse, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen.

- **Betriebsausgaben**

**Übergangstätigkeiten** sind Wirtschaftstätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

**Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.**



\* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

### Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Im Referenzzeitraum betrug der Anteil der Investitionen des Fonds, die in Übergangstätigkeiten geflossen sind, 0,00 % und der Anteil der Investitionen, die in ermöglichende Tätigkeiten geflossen ist, 0,00 %.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

| Indikator   | 2023-2024 | 2022-2023 |
|---|-----------|-----------|
| Umsatz – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                       | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform: Kernenergie                        | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie) | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Nicht taxonomiekonform                               | 100,00 %  | 100,00 %  |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                        | n. z.     | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                         | n. z.     | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)  | n. z.     | 0,00 %    |
| CAPEX – Nicht taxonomiekonform                                | 100,00 %  | 100,00 %  |
| OPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                         | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                          | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)   | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Nicht taxonomiekonform                                 | 100,00 %  | 100,00 %  |

Da es sich erst um den zweiten Berichtszeitraum des Teilfonds handelt, ist ein Vergleich mit der Zeit davor nicht erforderlich.

 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?**

Der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel war 0,02 %. Der Teilfonds hat sich nicht verpflichtet, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen.

 **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Teilfonds investierte nicht in sozial nachhaltige Anlagen.

 **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

#2 Andere Investitionen umfasst die Finanzinstrumente, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden. In manchen Fällen ist dies auf die Nichtverfügbarkeit von Daten und Unternehmensmaßnahmen zurückzuführen. Diese Positionen unterlagen nach wie vor dem vollständigen Ausschluss-Screening von HSBC und wurden im Hinblick auf verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Prinzipien des UNGC und der OECD geprüft.

Der Teilfonds hielt Barmittel / Barmitteläquivalente (der Prozentsatz der gehaltenen Barmittel ist in der obigen Tabelle der Sektoren/Teilsektoren unter der Überschrift „In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?“ ersichtlich) zum Zwecke des Liquiditätsmanagements sowie derivative Finanzinstrumente zum Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements. Barmittel / Barmitteläquivalente und derivative Finanzinstrumente verfügen aufgrund der Art dieser Instrumente über keinen ökologischen oder sozialen Mindestschutz.



## Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Im Laufe des Berichtszeitraums schloss der Anlageberater unter anderem verbotene Waffen, umstrittene Waffen, Unternehmen, die mehr als 10 % ihres Umsatzes aus Kraftwerkskohle und Energieerzeugung aus Kohle generieren, und Tabakherstellung aus und investierte in Unternehmen mit verantwortungsvollen Geschäftspraktiken gemäß den Prinzipien des UNGC.

Nach der Identifizierung des zulässigen Anlageuniversums konstruierte der Anlageberater ein Portfolio, dessen CO<sub>2</sub>-Intensität (berechnet als gewichteter Durchschnitt der CO<sub>2</sub>-Intensitäten der Anlagen des Teilfonds) niedriger ist als der gewichtete Durchschnitt der Bestandteile des Referenzwerts. Dies führte zu einem PAI-Score, der unter dem Referenzwert lag. Der Teilfonds bewertete auch ESG-Scores mit dem Ergebnis, dass der ESG-Score während des gesamten Berichtszeitraums über dem des Referenzwerts lag.

Darüber hinaus wurden alle Positionen auf Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der OECD untersucht, um Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung innerhalb des Portfolios sicherzustellen.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend.

● **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Nicht zutreffend.

● **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?**

Nicht zutreffend.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen 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.

Name des Produkts: HSBC GLOBAL INVESTMENT FUNDS - GLOBAL LOWER CARBON BOND

Unternehmenskennung (LEI-Code): 213800QEYRDOII07S350

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

| Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?  |   |
|--|---|
| <input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> <input type="checkbox"/> Ja  | <input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> Nein   |
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel</b> getätigt: _ %<br><br><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><br><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit <b>ökologische/soziale Merkmale beworben</b> und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 28,28 % an nachhaltigen Investitionen<br><br><input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><br><input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><br><input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel |
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel</b> getätigt: _ %  | <input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.</b>  |



### Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Während des Geschäftsjahres zum 31. März 2024 (der Bezugszeitraum) bewarb der Teilfonds Folgendes:

1. Aktive Berücksichtigung von Investitionen mit geringer CO2-Intensität im Vergleich zum Referenzwert.
2. Der Teilfonds berücksichtigte verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Grundsätzen des Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC) und den Leitsätzen für multinationale Unternehmen der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für Unternehmen. Wurden potenzielle Verstöße gegen die Prinzipien des UNGC festgestellt, wurden die Emittenten einer eigenen Due-Diligence-Prüfung hinsichtlich ESG-Themen unterzogen, um festzustellen, ob sie für die Aufnahme in das Portfolio des Teilfonds geeignet sind, und sie auszuschließen, falls sie als ungeeignet erachtet wurden.
3. Mindestumweltstandards durch den Ausschluss von als umweltschädlich eingestuften Geschäftstätigkeiten, wie z. B. die Förderung von Kraftwerkskohle und die Kohleverstromung.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

4. Die Identifikation und Analyse von Unternehmen im Hinblick auf ökologische Merkmale, insbesondere bezüglich physischer Risiken durch den Klimawandel und Personalmanagement.
5. Der Teilfonds berücksichtigte aktiv ökologische und soziale Aspekte, indem er über unsere Engagement- und Stewardship-Teams Mitwirkung bei Emittenten umsetzte, wo HSBC Asset Management dies für angemessen hielt.
6. Analyse des Anteils der Investitionen mit Beteiligung an umstrittenen Waffen

Der Bloomberg Global aggregate Corporate Diversified Hedged USD wurde zur Messung der Kohlenstoffintensität des Teilfonds herangezogen, diente aber nicht der Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale des Teilfonds.

Die ESG-Scores stammen vom externen ESG-Datenanbieter MSCI. Die Berücksichtigung einzelner wichtigster nachteiliger Auswirkungen (PAI) wird in der nachstehenden Tabelle anhand ihrer Nummerierung im Vergleich zum Referenzwert angegeben. Die bei der Berechnung der PAI-Werte verwendeten Daten stammen von externen Datenanbietern. Sie können auf Emittentenangaben basieren oder von den Datenanbietern geschätzt werden, wo keine solchen Emittentenangaben vorliegen. Bitte beachten Sie, dass es nicht immer möglich ist, die Richtigkeit, Aktualität oder Vollständigkeit der von Drittanbietern bereitgestellten Daten zu garantieren.

Der Referenzwert wurde für den Marktvergleich herangezogen, diente aber nicht der Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale des Teilfonds.

Das Abschneiden der Nachhaltigkeitsindikatoren, die der Teilfonds zur Messung der Erreichung der von ihm beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet, ist in der folgenden Tabelle dargestellt. Es wurde auf das Erreichen eines ESG-Score des Teilfonds hingearbeitet, der über dem vom Teilfonds ausgewählten Referenzindex liegt (ein höherer Score als der Referenzwert bedeutet bessere ESG-Referenzen).

Alle Unternehmen/Emittenten haben eine gute Unternehmensführung bewiesen, was sich am PAI-Score 10 unten ablesen lässt

### ● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

| <b>Indikator</b>   | <b>Teilfonds</b> | <b>Referenzwert</b> |
|--|------------------|---------------------|
| ESG-Score  | 7,33             | 7,20                |
| E-Säule  | 7,71             | 7,52                |
| S-Säule  | 5,25             | 5,09                |
| G-Säule  | 6,07             | 5,85                |
| 1. THG-Emissionen – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente  | 2.135,15         | 501.925,58          |
| 2. CO <sub>2</sub> -Fußabdruck – Tonnen CO <sub>2</sub> pro Million Euro (EVIC)  | 13,61            | 59,18               |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente pro Million Euro Umsatz   | 55,21            | 97,31               |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 1,12 %           | 0,29 %              |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 0,00 %           | 0,00 %              |

Die Daten in diesem regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung beziehen sich auf den Stand vom 31. März 2024, basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des am 31. März 2024 endenden Geschäftsjahres.

Referenzwert – Bloomberg Global Aggregate Corporates Diversified

### ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

| Indikator  | Zeitraum zum  | Teilfonds | Referenzwert |
|--|---------------|-----------|--------------|
| ESG-Score  | 31. März 2024 | 7,33      | 7,20         |
|  | 31. März 2023 | 7,24      | 6,98         |
| E-Säule  | 31. März 2024 | 7,71      | 7,52         |
|  | 31. März 2023 | 7,62      | 7,28         |
| S-Säule  | 31. März 2024 | 5,25      | 5,09         |
|  | 31. März 2023 | 5,30      | 5,02         |
| G-Säule  | 31. März 2024 | 6,07      | 5,85         |
|  | 31. März 2023 | 5,87      | 5,84         |
| 1. THG-Emissionen – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente  | 31. März 2024 | 2.135,15  | 501.925,58   |
|  | 31. März 2023 | 2.015,17  | 618.146,33   |
| 2. CO <sub>2</sub> -Fußabdruck – Tonnen CO <sub>2</sub> pro Million Euro (EVIC)  | 31. März 2024 | 13,61     | 59,18        |
|  | 31. März 2023 | 13,74     | 61,93        |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente pro Million Euro Umsatz   | 31. März 2024 | 55,21     | 97,31        |
|  | 31. März 2023 | 57,85     | 185,66       |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 31. März 2024 | 1,12 %    | 0,29 %       |
|  | 31. März 2023 | 1,83 %    | 1,86 %       |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 31. März 2024 | 0,00 %    | 0,00 %       |
|  | 31. März 2023 | 0,00 %    | 0,00 %       |

Da es sich erst um den zweiten regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung handelt, ist kein Vergleich mit vorangegangenen Zeiträumen möglich.

### **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die vom Teilfonds getätigten nachhaltigen Investitionen trugen unter anderem zu folgenden ökologischen Zielen bei:

1. Reduzierung von Treibhausgasemissionen und Verringerung des CO<sub>2</sub>-Fußabdrucks;
2. Übergang zu oder die Nutzung von erneuerbarer Energie.

Der Fonds bezieht die Identifizierung und Analyse der ESG-Referenzen eines Emittenten als integralen Bestandteil in den Anlageentscheidungsprozess ein, um die Bewertung von Risiken und potenziellen Renditen zu unterstützen.

### **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Wir bestätigen, dass wir nachhaltige Vermögenswerte darauf geprüft haben, ob sie erhebliche Beeinträchtigungen verursachen können. Dies erfolgte im Rahmen des Standard-Anlageprozesses von HSBC Asset Management (HSBC) und unter Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen.

*Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?*

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 Anlageberater hat alle durch die Offenlegungsverordnung definierten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI) auf ihre Relevanz für den Teilfonds geprüft. Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren legt fest, wie HSBC die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen identifiziert und darauf reagiert, und in welcher Form HSBC Nachhaltigkeitsrisiken berücksichtigt, die sich negativ auf Wertpapiere auswirken können, in die der Teilfonds investiert. HSBC identifizierte in Zusammenarbeit mit externen Screening-Dienstleistern wie Sustainalytics, ISS, MSCI und Trucost Unternehmen und Staaten mit schlechter Bilanz beim Management von ESG-Risiken, und wo solche wesentlichen Risiken identifiziert wurden, führte HSBC zusätzliche Due Diligence-Prüfungen durch. Durch Screening identifizierte Nachhaltigkeitsauswirkungen, einschließlich der relevanten PAI, bildeten einen Schlüsselfaktor beim Anlageentscheidungsprozess.

Der oben beschriebene Ansatz führte dazu, dass unter anderem folgende Faktoren geprüft wurden:

- Engagement der Unternehmen für den Übergang zu CO<sub>2</sub>-armen Wirtschaften, zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern, Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus großen Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails. Ebenfalls berücksichtigt wurde das Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit den Bereichen demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.

Die spezifischen PAI für diesen Teilfonds waren wie unten beschrieben.

Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren ist auf der Website [www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies](http://www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies) verfügbar.

*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:*

HSBC hat sich der Anwendung und Förderung globaler Standards verpflichtet. Die wichtigsten Schwerpunktbereiche der Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren entsprachen den zehn UNGC-Grundsätzen. Diese Grundsätze stehen in Zusammenhang mit nicht finanziellen Risiken in den Bereichen Menschenrechte, Arbeit, Umweltschutz und Korruptionsbekämpfung. HSBC gehört darüber hinaus zu den Unterzeichnern der UN Principles for Responsible Investment. Dies bildete den Rahmen für den Investitionsansatz von HSBC, indem Nachhaltigkeitsrisiken identifiziert und gemanagt wurden. Von Emittenten, in die der Teilfonds investiert, wird erwartet, dass sie die Anforderungen des UNGC und die damit verbundenen Standards einhalten. Emittenten, die belegbar gegen einen der zehn Grundsätze des UNGC verstießen, wurden systematisch ausgeschlossen. Der Teilfonds führt verstärkte Due-Diligence-Prüfungen hinsichtlich ESG-Themen bei Unternehmen durch, die als nicht konform mit den Prinzipien des UNGC angesehen wurden oder die nach den unternehmenseigenen ESG-Ratings von HSBC als risikoreich angesehen wurden. Darüber hinaus wurden die Unternehmen nach internationalen Standards wie den OECD-Leitsätzen bewertet.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen. Hierbei gelten spezifische von der Union definierte Kriterien.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*



### **Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Der Teilfonds berücksichtigte die folgenden PAI, indem er sie als Nachhaltigkeitsindikatoren beobachtete:

- Treibhausgasemissionen (Scope 1 und Scope 2)
- CO<sub>2</sub>-Fußabdruck (Scope 1 und Scope 2)
- Treibhausgasintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1 und Scope 2)
- Verstöße gegen die Prinzipien des UNGC und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD)
- Anteil der Investitionen mit Beteiligung an umstrittenen Waffen

Der Ansatz zur Berücksichtigung der PAI beinhaltete unter anderem, dass HSBC das Engagement der Unternehmen für den Übergang zu CO<sub>2</sub>-armen Wirtschaften, die zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern sowie die Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette prüfte, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails. Ebenfalls berücksichtigt wird das Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit den Bereichen demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung und Gesundheitsversorgung, sowie neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Bekämpfung von Korruption und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.

Das Screening führte dazu, dass HSBC nicht in bestimmte Unternehmen und Emittenten investierte.





## Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der Investitionen** entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden: basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des Bezugszeitraums zum 31.03.2024

| Größte Investitionen   | Sektor           | % der Vermögenswerte | Land                           |
|--|------------------|----------------------|--------------------------------|
| Paccar Financial Corp. 4,6 %<br>31.01.2029                       | Finanzen         | 1,62 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| New York Life Global Funding<br>4,7 % 29.01.2029                 | Finanzen         | 1,21 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Ashtead Capital, Inc.<br>5,8 % 15.04.2034                        | Industriegüter   | 1,16 %               | Vereinigtes Königreich         |
| Government Of The United States<br>Of America 4,75 % 15.11.2053  | Staatsanleihen   | 1,07 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Jpmorgan Chase & Co. 4,6 % Perp                                  | Finanzen         | 0,98 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Assicurazioni Generali S.p.a.<br>5,272 % 12.09.2033              | Finanzen         | 0,96 %               | Italien                        |
| Schneider Electric Se 3,25 %<br>10.10.2035                       | Industriegüter   | 0,88 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Government Of The United States<br>Of America 4,25 % 15.03.2027  | Staatsanleihen   | 0,85 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Ferrovial S.e.<br>4,375 % 13.09.2030                             | Industriegüter   | 0,84 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Corebridge Global Funding<br>5,9 % 19.09.2028                    | Finanzen         | 0,83 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Credit Agricole S.a. 5,134 %<br>11.03.2027                       | Finanzen         | 0,81 %               | Frankreich                     |
| Government Of The United States<br>Of America 4,125 % 31.03.2031 | Staatsanleihen   | 0,81 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Amgen Inc. 4,05 % 18.08.2029                                     | Gesundheitswesen | 0,78 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Government Of The United States<br>Of America 4,125 % 15.08.2053 | Staatsanleihen   | 0,78 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Deutsche Bank Aktiengesellschaft<br>5,0 % 05.09.2030             | Finanzen         | 0,75 %               | Deutschland                    |

Barmittel und Derivate wurden nicht berücksichtigt

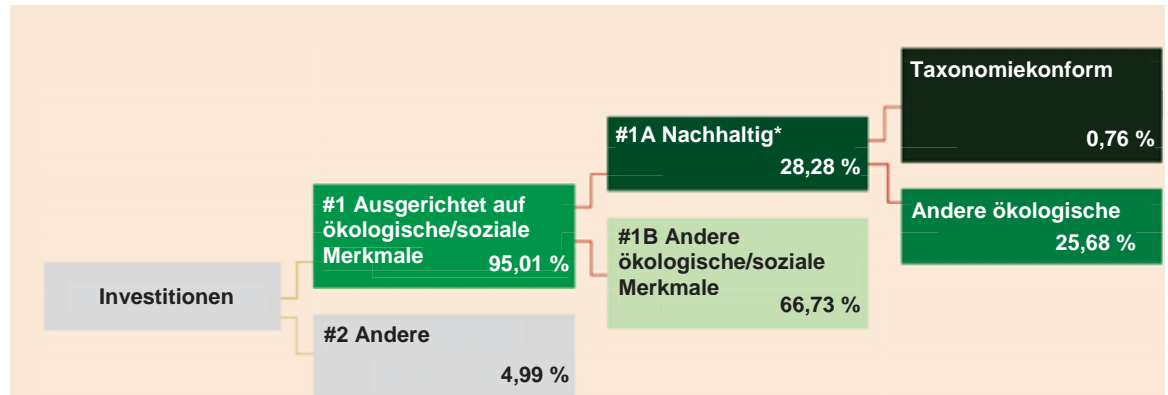


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

26,78 % des Portfolios waren in nachhaltige Vermögenswerte investiert.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?



**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**#2 Andere Investitionen** umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:  
 - Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.  
 - Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

\* Ein Unternehmen oder Emittent, das bzw. der als nachhaltige Investition angesehen wird, kann sowohl zu einem sozialen als auch zu einem ökologischen Ziel beitragen, das an der EU-Taxonomie ausgerichtet sein kann oder nicht. Die Zahlen in der obigen Grafik berücksichtigen dies. Jedoch darf eine Gesellschaft oder ein Emittent unter dem Punkt der nachhaltigen Investitionen (#1A Nachhaltige Investitionen) nur einmal erfasst werden.

Die Prozentzahlen von taxonomiekonformen Investitionen und Andere ökologische Merkmale stimmen aufgrund der unterschiedlichen Berechnungsmethoden für nachhaltige Investitionen und taxonomiekonforme Investitionen nicht mit #1A Nachhaltige Investitionen überein.

### In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

| Sektor / Teilsektor                          | % der Vermögenswerte |
|--|----------------------|
| Finanzen                                     | 39,85 %              |
| Andere                                       | 16,28 %              |
| <i>Lagerung und Transport von Öl und Gas</i> | 0,88 %               |
| Barmittel und Derivate                       | 3,76 %               |
| Staatsanleihen                               | 6,57 %               |
| Kommunikationsdienstleistungen               | 6,07 %               |
| Industriegüter                               | 5,41 %               |
| Basiskonsumgüter                             | 4,06 %               |
| Immobilien                                   | 3,92 %               |
| Gesundheitswesen                             | 3,70 %               |
| Versorger                                    | 3,37 %               |
| <i>Stromversorgungsbetriebe</i>              | 1,95 %               |
| <i>Multi-Versorger</i>                       | 1,26 %               |
| Informationstechnologie                      | 3,17 %               |
| Zyklische Konsumgüter                        | 2,99 %               |
| Grundstoffe                                  | 0,86 %               |
| Summe  | 100,00 %             |



## Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

Der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen ist in den obigen Feldern zur Vermögensallokation ersichtlich.

### Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

Ja:
   
 In fossiles Gas
   
 In Kernenergie
   
 Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

**Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

*Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.*



\* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

### Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?


Im Referenzzeitraum betrug der Anteil der Investitionen des Fonds, die in Übergangstätigkeiten geflossen sind, 0,04 % und der Anteil der Investitionen, die in ermöglichende Tätigkeiten geflossen ist, 0,42 %.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

| Indikator   | 2023-2024 | 2022-2023 |
|---|-----------|-----------|
| Umsatz – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                       | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform: Kernenergie                        | 0,04 %    | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie) | 0,72 %    | 0,00 %    |
| Umsatz – Nicht taxonomiekonform                               | 99,24 %   | 100,00 %  |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                        | n. z.     | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                         | 0,07 %    | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)  | 1,77 %    | 0,00 %    |
| CAPEX – Nicht taxonomiekonform                                | 98,16 %   | 100,00 %  |
| OPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                         | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                          | 0,11 %    | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)   | 1,45 %    | 0,00 %    |
| OPEX – Nicht taxonomiekonform                                 | 98,43 %   | 100,00 %  |

Da es sich erst um den zweiten Berichtszeitraum des Teilfonds handelt, ist ein Vergleich mit der Zeit davor nicht erforderlich.

 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?**

Der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel war 25,68 %. Der Teilfonds hat sich nicht verpflichtet, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen.

 **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Teilfonds investierte nicht in sozial nachhaltige Anlagen.

 **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

#2 Andere Investitionen umfasst die Finanzinstrumente, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden. In manchen Fällen ist dies auf die Nichtverfügbarkeit von Daten und Unternehmensmaßnahmen zurückzuführen. Diese Positionen unterlagen nach wie vor dem vollständigen Ausschluss-Screening von HSBC und wurden im Hinblick auf verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Prinzipien des UNGC und der OECD geprüft.

Der Teilfonds hielt Barmittel / Barmitteläquivalente (der Prozentsatz der gehaltenen Barmittel ist in der obigen Tabelle der Sektoren/Teilsektoren unter der Überschrift „In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?“ ersichtlich) zum Zwecke des Liquiditätsmanagements sowie derivative Finanzinstrumente zum Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements. Barmittel / Barmitteläquivalente und derivative Finanzinstrumente verfügen aufgrund der Art dieser Instrumente über keinen ökologischen oder sozialen Mindestschutz.



## Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Im Laufe des Berichtszeitraums schloss der Anlageberater unter anderem verbotene Waffen, umstrittene Waffen, Unternehmen, die mehr als 10 % ihres Umsatzes aus Kraftwerkskohle und Energieerzeugung aus Kohle generieren, und Tabakherstellung aus und investierte in Unternehmen mit verantwortungsvollen Geschäftspraktiken gemäß den Prinzipien des UNGC.

Nach der Identifizierung des zulässigen Anlageuniversums konstruierte der Anlageberater ein Portfolio, dessen CO<sub>2</sub>-Intensität (berechnet als gewichteter Durchschnitt der CO<sub>2</sub>-Intensitäten der Anlagen des Teilfonds) niedriger ist als der gewichtete Durchschnitt der Bestandteile des Referenzwerts. Dies führte zu einem PAI-Score, der unter dem Referenzwert lag. Der Teilfonds bewertete auch ESG-Scores mit dem Ergebnis, dass der ESG-Score während des gesamten Berichtszeitraums über dem des Referenzwerts lag.

Darüber hinaus wurden alle Positionen auf Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der OECD untersucht, um Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung innerhalb des Portfolios sicherzustellen.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Nicht zutreffend.

- **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?**

Nicht zutreffend.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen 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.

Name des Produkts: HSBC GLOBAL INVESTMENT FUNDS - GLOBAL SECURITISED CREDIT BOND

Unternehmenskennung (LEI-Code): 213800ETF03K123TXM05

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

| <input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> <input type="checkbox"/> <b>Ja</b>   | <input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> <b>Nein</b>   |
|---|--|
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel</b> getätigt: _ %<br><br><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><br><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><br><input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel</b> getätigt: _ % | <input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit <b>ökologische/soziale Merkmale beworben</b> und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 0,04 % an nachhaltigen Investitionen<br><br><input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><br><input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><br><input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel<br><br><input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine <b>nachhaltigen Investitionen getätigt</b> |



### Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Während des Geschäftsjahres zum 31. März 2024 (der Bezugszeitraum) bewarb der Teilfonds die folgenden Merkmale:

- Der Teilfonds investierte in Wertpapiere, die Klimaschutz- oder umweltschutzbezogene Projekte unterstützten.
- Der Teilfonds berücksichtigte verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Grundsätzen des Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC) und den Leitsätzen für multinationale Unternehmen der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für Unternehmen. Wurden potenzielle Verstöße gegen die Prinzipien des UNGC festgestellt, wurden die Emittenten einer eigenen Due-Diligence-Prüfung hinsichtlich ESG-Themen unterzogen, um festzustellen, ob sie für die Aufnahme in das Portfolio des Teilfonds geeignet sind, und sie auszuschließen, falls sie als ungeeignet erachtet wurden.
- Der Teilfonds schloss Geschäftstätigkeiten aus, die als umweltschädlich gelten, wie z. B. die Förderung von Kraftwerkskohle und die Kohleverstromung.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

4. Der Teilfonds prüfte und analysierte alle Unternehmen oder Emittenten im Hinblick auf ökologische Merkmale, insbesondere physische Risiken durch den Klimawandel und Personalmanagement.
5. Der Teilfonds berücksichtigte aktiv ökologische und soziale Aspekte, indem er über unsere Engagement- und Stewardship-Teams Mitwirkung bei Emittenten umsetzte, wo HSBC Asset Management dies für angemessen hielt.
6. Der Teilfonds schloss nach entsprechender Analyse Anlagen in umstrittenen Waffen aus.

Die auf ESG und Nachhaltigkeitsindikatoren bezogenen Scores werden anhand der proprietären Methodik von HSBC Asset Management und externer ESG-Datenanbieter berechnet. Wir verwenden ESG-Scores von Drittanbietern (z. B. ESG-Scores von MSCI) und haben auch eigene Scores entwickelt, um unsere eigene Sicht der ESG-Risiken und -Chancen widerzuspiegeln. Wir haben eine maßgeschneiderte Branchensegmentierung entwickelt (abgeleitet vom MSCI Global Industry Classification Standard), bei der wir die Wesentlichkeit der wichtigsten E-, S- und G-Faktoren von MSCI auf einer sektoralen Basis neu bewerten und eine sektorspezifische HSBC-ESG-Gewichtung erstellen.

Die Berücksichtigung einzelner wichtigster nachteiliger Auswirkungen (PAI) wird in der nachstehenden Tabelle anhand ihrer Nummerierung im Vergleich zum Referenzwert angegeben. Die bei der Berechnung der PAI-Werte verwendeten Daten stammen von externen Datenanbietern. Sie können auf Unternehmens-/Emittentenangaben basieren oder von den Datenanbietern geschätzt werden, wo keine solchen Angaben vorliegen. Bitte beachten Sie, dass es nicht immer möglich ist, die Richtigkeit, Aktualität oder Vollständigkeit der von Drittanbietern bereitgestellten Daten zu garantieren. Der Referenzwert wurde für den Marktvergleich herangezogen, diente aber nicht der Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale des Teilfonds.

Das Abschneiden der Nachhaltigkeitsindikatoren, die der Teilfonds zur Messung der Erreichung der von ihm beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet, ist in der folgenden Tabelle dargestellt. Es wurde auf das Erreichen eines ESG-Score des Teilfonds hingearbeitet, der über dem vom Teilfonds ausgewählten Referenzindex liegt (ein höherer Score als der Referenzwert bedeutet bessere ESG-Referenzen).

Alle Unternehmen/Emittenten haben eine gute Unternehmensführung bewiesen, was sich am PAI-Score 10 unten ablesen lässt.

### **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

| <b>Indikator</b>   | <b>Teilfonds</b> |
|--|------------------|
| ESG-Score  | 5,05             |
| E-Säule  | 5,89             |
| S-Säule  | 4,84             |
| G-Säule  | 5,03             |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 0,00 %           |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 0,00 %           |

Die Daten in diesem regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung beziehen sich auf den Stand vom 31. März 2024, basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des am 31. März 2024 endenden Geschäftsjahres.

## ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

| Indikator  | Zeitraum zum  | Teilfonds |
|--|---------------|-----------|
| ESG-Score  | 31. März 2024 | 5,05      |
|  | 31. März 2023 | 7,36      |
| E-Säule  | 31. März 2024 | 5,89      |
|  | 31. März 2023 | 8,08      |
| S-Säule  | 31. März 2024 | 4,84      |
|  | 31. März 2023 | 4,70      |
| G-Säule  | 31. März 2024 | 5,03      |
|  | 31. März 2023 | 5,72      |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 31. März 2024 | 0,00 %    |
|  | 31. März 2023 | 0,00 %    |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 31. März 2024 | 0,00 %    |
|  | 31. März 2023 | 0,00 %    |

Da es sich erst um den zweiten regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung handelt, ist kein Vergleich mit vorangegangenen Zeiträumen möglich.

## Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Die vom Teilfonds getätigten nachhaltigen Investitionen trugen unter anderem zu folgenden ökologischen Zielen bei:

1. Reduzierung von Treibhausgasemissionen und Verringerung des CO<sub>2</sub>-Fußabdrucks;
2. Übergang zu oder die Nutzung von erneuerbarer Energie.

Der Fonds bezieht die Identifizierung und Analyse der ESG-Referenzen eines Emittenten als integralen Bestandteil in den Anlageentscheidungsprozess ein, um die Bewertung von Risiken und potenziellen Renditen zu unterstützen.

## Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Wir bestätigen, dass wir nachhaltige Vermögenswerte darauf geprüft haben, ob sie erhebliche Beeinträchtigungen verursachen können. Dies erfolgte im Rahmen des Standard-Anlageprozesses von HSBC Asset Management (HSBC) und unter Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen.

*Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?*

Der Anlageberater hat alle durch die Offenlegungsverordnung definierten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI) auf ihre Relevanz für den Teilfonds geprüft. Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren legt fest, wie HSBC die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen identifiziert und darauf reagiert, und in welcher Form HSBC Nachhaltigkeitsrisiken berücksichtigt, die sich negativ auf Wertpapiere auswirken können, in die der Teilfonds investiert. HSBC identifizierte in Zusammenarbeit mit externen Screening-Dienstleistern wie Sustainalytics, ISS, MSCI und Trucost Unternehmen und Staaten mit schlechter Bilanz beim Management von ESG-Risiken, und wo solche wesentlichen Risiken identifiziert wurden, führte HSBC zusätzliche Due Diligence-Prüfungen durch. Durch Screening identifizierte Nachhaltigkeitsauswirkungen, einschließlich der relevanten PAI, bildeten einen Schlüsselfaktor beim Anlageentscheidungsprozess.

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 oben beschriebene Ansatz führte dazu, dass unter anderem folgende Faktoren geprüft wurden:

- Engagement der Unternehmen für den Übergang zu CO<sub>2</sub>-armen Wirtschaften, zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern, Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus großen Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails; und
- Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit folgenden Bereichen: demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.

Die spezifischen PAI für diesen Teilfonds waren wie unten beschrieben.

Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren ist auf der Website [www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies](http://www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies) verfügbar.

*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:*

HSBC hat sich der Anwendung und Förderung globaler Standards verpflichtet. Die wichtigsten Schwerpunktbereiche der Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren entsprachen den zehn UNGC-Grundsätzen. Diese Grundsätze stehen in Zusammenhang mit nicht finanziellen Risiken in den Bereichen Menschenrechte, Arbeit, Umweltschutz und Korruptionsbekämpfung. HSBC gehört darüber hinaus zu den Unterzeichnern der UN Principles for Responsible Investment. Diese bildeten den Rahmen für Ermittlung und Management von Nachhaltigkeitsrisiken beim Investmentansatz von HSBC. Von Unternehmen, in die der Teilfonds investierte, wurde erwartet, dass sie die Anforderungen des UNGC und der damit verbundenen Standards erfüllen. Unternehmen, die belegbar gegen einen der zehn Grundsätze des UNGC verstießen, wurden systematisch ausgeschlossen. Der Teilfonds führte verstärkte Due-Diligence-Prüfungen bei Unternehmen durch, die als nicht konform mit den Prinzipien des UNGC angesehen wurden oder die nach den unternehmenseigenen ESG Ratings von HSBC als risikoreich angesehen wurden. Darüber hinaus wurden die Unternehmen nach internationalen Standards wie den OECD-Leitsätzen bewertet.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen. Hierbei gelten spezifische von der Union definierte Kriterien.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*



## Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die vom Teilfonds berücksichtigte wichtigste nachteilige Auswirkungen waren:

- Treibhausgasintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1 und Scope 2)
- Verstöße gegen die UNGC- und OECD-Grundsätze
- Anteil der Investitionen mit Beteiligung an umstrittenen Waffen

Der Ansatz zur Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen beinhaltet unter anderem, dass HSBC das Engagement der Unternehmen für den Übergang zu kohlenstoffarmem Wirtschaften, die zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern sowie die Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette prüfte, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails. Ebenfalls berücksichtigt wurde das Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit den Bereichen demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.

Das Screening führte dazu, dass HSBC nicht in bestimmte Unternehmen und Emittenten investierte.



## Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der Investitionen** entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden: basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des Bezugszeitraums zum 31.03.2024

| Größte Investitionen                                    | Sektor   | % der Vermögenswerte | Land  |
|---|----------|----------------------|---|
| HSBC GLF-USD ESG LIQ-Y 11315951                         | Andere   | 4,05 %               | Irland  |
| PLRS 2021-1 C 11381576                                  | Andere   | 2,71 %               | Vereinigtes Königreich von Großbritannien und Nordirland. |
| HPA 2021-2 E1 11050067                                  | Andere   | 2,56 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| STRA 2021-3 B 11368485                                  | Finanzen | 2,34 %               | Vereinigtes Königreich von Großbritannien und Nordirland. |
| Last Mile Logistics Pan Euro Finance DAC Frn 17.08.2033 | Finanzen | 2,02 %               | Irland  |
| BBCMS 2018-TALL D 10421044                              | Andere   | 1,91 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| HY 2019-30HY E 10454380                                 | Andere   | 1,88 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| CAMB 2019-LIFE D 10387045                               | Andere   | 1,83 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| STACR 2021-DNA3 M2 11379197                             | Andere   | 1,82 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| APID 2019-31A DR 10891817                               | Andere   | 1,81 %               | Kaimaninseln  |
| NEUB 2017-26A C 10245678                                | Andere   | 1,81 %               | Kaimaninseln  |
| WHTPK 2021-1A D 11047858                                | Andere   | 1,78 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| PRK 2017-280P D 10491084                                | Andere   | 1,65 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| ATOMM 1X C 11024495                                     | Andere   | 1,63 %               | Irland  |
| St. Paul's Clo Xii Dac Frn 15.04.2033                   | Finanzen | 1,60 %               | Irland  |

Barmittel und Derivate wurden nicht berücksichtigt

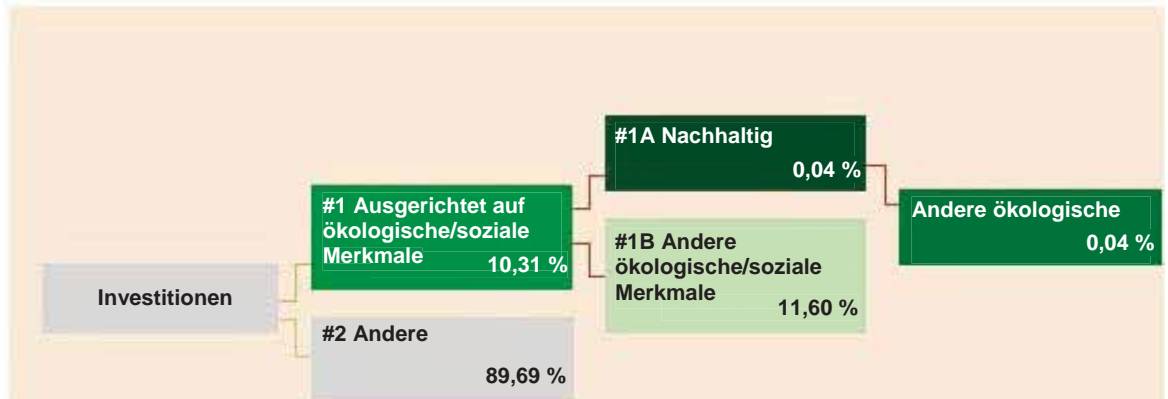


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

0,04 % des Portfolios waren in nachhaltige Vermögenswerte investiert.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?



**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**#2 Andere Investitionen** umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:  
 - Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.  
 - Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

### In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

| Sektor / Teilsektor            | % der Vermögenswerte |
|--------------------------------|----------------------|
| Andere                         | 71,67 %              |
| Finanzen                       | 25,50 %              |
| Immobilien                     | 1,73 %               |
| Kommunikationsdienstleistungen | 1,47 %               |
| Staatsanleihen                 | 0,10 %               |
| Barmittel und Derivate         | -0,47 %              |
| Summe                          | 100,00 %             |



Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO2-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

## Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

Der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen lag bei 0 %. Der Teilfonds hat sich nicht verpflichtet, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen.

### Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

Ja:
  In fossiles Gas
  In Kernenergie

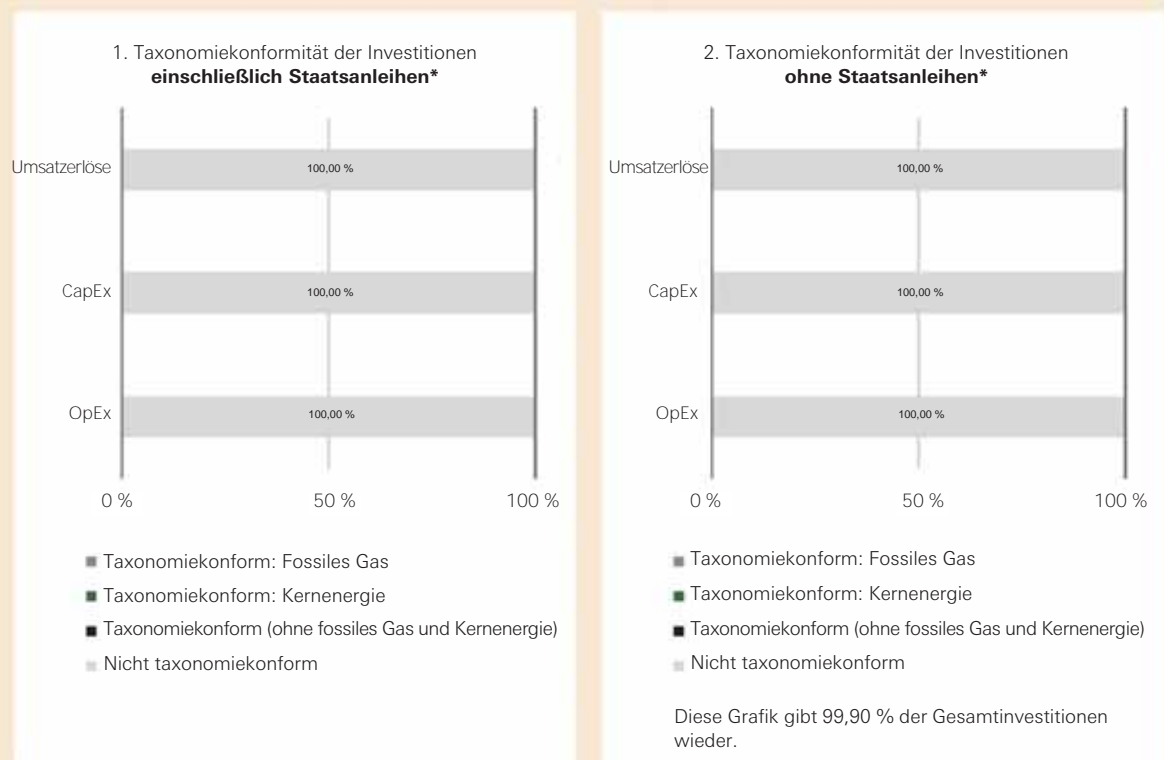
Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

**Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.**



\* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

### Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Im Referenzzeitraum betrug der Anteil der Investitionen des Fonds, die in Übergangstätigkeiten geflossen sind, 0,00 % und der Anteil der Investitionen, die in ermöglichende Tätigkeiten geflossen ist, 0,00 %.

**Übergangstätigkeiten** sind Wirtschaftstätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

| Indikator   | 2023-2024 | 2022-2023 |
|---|-----------|-----------|
| Umsatz – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                       | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform: Kernenergie                        | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie) | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Nicht taxonomiekonform                               | 100,00 %  | 100,00 %  |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                        | n. z.     | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                         | n. z.     | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)  | n. z.     | 0,00 %    |
| CAPEX – Nicht taxonomiekonform                                | 100,00 %  | 100,00 %  |
| OPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                         | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                          | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)   | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Nicht taxonomiekonform                                 | 100,00 %  | 100,00 %  |

Da es sich erst um den zweiten Berichtszeitraum des Teilfonds handelt, ist ein Vergleich mit der Zeit davor nicht erforderlich.

 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?**

Der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel war 0,04 %. Aufgrund der mangelnden Abdeckung und der fehlenden Daten hat sich der Teilfonds nicht verpflichtet, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen.

 **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Teilfonds investierte nicht in sozial nachhaltige Anlagen.

 **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

#2 Andere Investitionen umfasst die Finanzinstrumente, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden. In manchen Fällen ist dies auf die Nichtverfügbarkeit von Daten und Unternehmensmaßnahmen zurückzuführen. Diese Positionen unterlagen nach wie vor dem vollständigen Ausschluss-Screening von HSBC und wurden im Hinblick auf verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Prinzipien des UNGC und der OECD geprüft.

Der Teilfonds hielt Barmittel / Barmitteläquivalente (der Prozentsatz der gehaltenen Barmittel ist in der obigen Tabelle der Sektoren/Teilsektoren unter der Überschrift „In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?“ ersichtlich) zum Zwecke des Liquiditätsmanagements sowie derivative Finanzinstrumente zum Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements. Barmittel / Barmitteläquivalente und derivative Finanzinstrumente verfügen aufgrund der Art dieser Instrumente über keinen ökologischen oder sozialen Mindestschutz.



## Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Im Laufe des Berichtszeitraums schloss der Anlageberater unter anderem verbotene Waffen, umstrittene Waffen, Unternehmen, die mehr als 10 % ihres Umsatzes aus Kraftwerkskohle und Energieerzeugung aus Kohle generieren, und Tabakherstellung aus und investierte in Unternehmen mit verantwortungsvollen Geschäftspraktiken gemäß den Prinzipien des UNGC.

Alle Positionen des Portfolios wurden hinsichtlich ihrer individuellen Treibhausgasintensität bewertet. Der Teilfonds bewertete auch ESG-Scores mit dem Ergebnis, dass der ESG-Score während des gesamten Berichtszeitraums vergleichbar mit dem des Referenzwerts war.

Darüber hinaus wurden alle Positionen auf Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der OECD untersucht, um Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung innerhalb des Portfolios sicherzustellen.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Nicht zutreffend.

- **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?**

Nicht zutreffend.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

**Name des Produkts:** HSBC GLOBAL INVESTMENT FUNDS - GLOBAL GOVERNMENT BOND

**Unternehmenskennung (LEI-Code):** 213800U23ATP2ADUS371

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen 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?   |   |
|---|---|
| <input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> <input type="checkbox"/> Ja   | <input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> Nein   |
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel</b> getätigt: _ %<br><br><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><br><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><br><input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel</b> getätigt: _ % | <input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit <b>ökologische/soziale Merkmale beworben</b> und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 2,71 % an nachhaltigen Investitionen<br><br><input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><br><input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><br><input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel<br><br><input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>ökologische/soziale Merkmale beworben</b> , aber keine <b>nachhaltigen Investitionen getätigt</b> |



### Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Während des Geschäftsjahres zum 31. März 2024 (der Bezugszeitraum) bewarb der Teilfonds Folgendes:

- Der Teilfonds prüfte und analysierte alle Unternehmen oder Emittenten im Hinblick auf ökologische Merkmale, insbesondere physische Risiken durch den Klimawandel und Personalmanagement. Für die zugrunde liegenden E-, S- und G-Säulen wurden ein Screening sowie ein Vergleich mit dem für den Teilfonds definierten Referenzwert durchgeführt. „E“ und „S“ spiegeln die einzelnen Elemente der vom Teilfonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale wider, „G“ die Unternehmensführungspraktiken, die die Interessen von Minderheitsaktionären schützen

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

und eine langfristige nachhaltige Wertschöpfung fördern.

2. Der Teilfonds berücksichtigte verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Grundsätzen des Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC) und den Leitsätzen für multinationale Unternehmen der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für Unternehmen. Wurden potenzielle Verstöße gegen die Prinzipien des UNGC festgestellt, wurden die Emittenten einer eigenen Due-Diligence-Prüfung hinsichtlich ESG-Themen unterzogen, um festzustellen, ob sie für die Aufnahme in das Portfolio des Teilfonds geeignet sind, und sie auszuschließen, falls sie als ungeeignet erachtet wurden.

3. Der Teilfonds schloss Geschäftstätigkeiten aus, die als umweltschädlich gelten, wie z. B. die Förderung von Kraftwerkskohle und die Kohleverstromung.

4. Der Teilfonds berücksichtigte aktiv ökologische und soziale Aspekte, indem er über unsere Engagement- und Stewardship-Teams Mitwirkung bei Emittenten umsetzte, wo HSBC Asset Management dies für angemessen hielt.

5. Der Teilfonds schloss Anlagen in umstrittenen Waffen aus.

Die ESG-Scores stammen vom externen ESG-Datenanbieter MSCI. Die Berücksichtigung einzelner (in der nachstehenden Tabelle nummerierter) wichtigster nachteiliger Indikatoren (PAI) drückt sich darin aus, dass der Teilfonds niedrigere Werte als der Referenzwert aufweist. Die bei der Berechnung der PAI-Werte verwendeten Daten stammen von externen Datenanbietern. Sie können auf Unternehmensangaben basieren oder von den Datenanbietern geschätzt werden, wo keine solchen Angaben vorliegen. Bitte beachten Sie, dass es nicht immer möglich ist, die Richtigkeit, Aktualität oder Vollständigkeit der von Drittanbietern bereitgestellten Daten zu garantieren.

Der Referenzwert für den Teilfonds wurde zur Beurteilung des ESG-Rating des Teilfonds angewandt. Das ESG-Rating des Teilfonds errechnet sich aus dem Vergleich des gewichteten Durchschnitts der ESG-Ratings der Emittenten des Teilfonds und dem gewichteten Durchschnitt der Bestandteile des Referenzwerts. Der Referenzwert diente jedoch nicht der Erreichung der vom Teilfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale.

Das Abschneiden der Nachhaltigkeitsindikatoren, die der Teilfonds zur Messung der Erreichung der von ihm beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet, ist in der folgenden Tabelle dargestellt. Es wurde auf das Erreichen eines ESG-Score des Teilfonds hingearbeitet, der über dem vom Teilfonds ausgewählten Referenzindex liegt (ein höherer Score als der Referenzwert bedeutet bessere ESG-Referenzen).

Alle Emittenten haben eine gute Unternehmensführung bewiesen, was sich am PAI-Score 10 unten ablesen lässt.

### ● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

| Indikator  | Teilfonds | Referenzwert |
|--|-----------|--------------|
| ESG-Score  | 6,30      | 6,19         |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO2-Äquivalente pro Million Euro Umsatz  | 150,90    | 0,00         |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 0,00 %    | 0,00 %       |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 0,00 %    | 0,00 %       |
| 15. THG-Emissionsintensität - Kennzahl in Kilotonnen pro BIP-Einheit (in Millionen Euro)   | 333,64    | 325,72       |

Die Daten in diesem regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung beziehen sich auf den Stand vom 31. März 2024, basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des am 31. März 2024 endenden Geschäftsjahres.

Referenzwert - JP Morgan GBI Global (Traded)



### **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

| <b>Indikator</b>   | <b>Zeitraum zum</b> | <b>Teilfonds</b> | <b>Referenzwert</b> |
|--|---------------------|------------------|---------------------|
| ESG-Score  | 31. März 2024       | 6,30             | 6,19                |
|  | 31. März 2023       | 6,12             | 6,57                |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente pro Million Euro Umsatz   | 31. März 2024       | 150,90           | 0,00                |
|  | 31. März 2023       | 160,87           | 0,00                |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 31. März 2024       | 0,00 %           | 0,00 %              |
|  | 31. März 2023       | 0,00 %           | 0,00 %              |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 31. März 2024       | 0,00 %           | 0,00 %              |
|  | 31. März 2023       | 0,00 %           | 0,00 %              |
| 15. THG-Emissionsintensität - Kennzahl in Kilotonnen pro BIP-Einheit (in Millionen Euro)   | 31. März 2024       | 333,64           | 325,72              |
|  | 31. März 2023       | 246,14           | 273,37              |

Da es sich erst um den zweiten regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung handelt, ist kein Vergleich mit vorangegangenen Zeiträumen möglich.

### **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die vom Teilfonds getätigten nachhaltigen Investitionen trugen unter anderem zu folgenden ökologischen Zielen bei:

1. Reduzierung von Treibhausgasemissionen und Verringerung des CO<sub>2</sub>-Fußabdrucks;
2. Übergang zu oder die Nutzung von erneuerbarer Energie.

Der Teilfonds identifizierte und analysierte ESG-Referenzen eines Unternehmens als wesentlichen Bestandteil des Anlageentscheidungsprozesses zur Reduzierung von Risiken und zur Steigerung der Renditen. Der Anlageberater zielt darauf ab, durch Berücksichtigung der ESG-Referenzen potenzieller Investitionen einen besseren ESG-Score zu erzielen als der Referenzwert.

### **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Wir bestätigen, dass wir nachhaltige Vermögenswerte darauf geprüft haben, ob sie erhebliche Beeinträchtigungen verursachen können. Dies erfolgte im Rahmen des Standard-Anlageprozesses von HSBC Asset Management (HSBC) und unter Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen.

*Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?*

Der Anlageberater hat alle durch die Offenlegungsverordnung definierten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI) auf ihre Relevanz für den Teilfonds geprüft. Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren legt fest, wie HSBC die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen identifiziert und darauf reagiert, und in welcher Form HSBC Nachhaltigkeitsrisiken berücksichtigt, die sich negativ auf Wertpapiere auswirken können, in die der Teilfonds investiert. HSBC identifizierte in Zusammenarbeit mit externen Screening-Dienstleistern wie Sustainalytics, ISS, MSCI und Trucost Unternehmen und Staaten mit schlechter

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.

Bilanz beim Management von ESG-Risiken, und wo solche wesentlichen Risiken identifiziert wurden, führte HSBC zusätzliche Due Diligence-Prüfungen durch. Durch Screening identifizierte Nachhaltigkeitsauswirkungen, einschließlich der relevanten PAI, bildeten einen Schlüsselfaktor beim Anlageentscheidungsprozess.

Der oben beschriebene Ansatz führte dazu, dass unter anderem folgende Faktoren geprüft wurden:

- Engagement der Unternehmen für den Übergang zu CO2-armen Wirtschaften, zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern, Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus großen Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails; und
- Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit folgenden Bereichen: demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.

Die spezifischen PAI für diesen Teilfonds waren wie unten beschrieben.

Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsvolles Investieren ist auf der Website verfügbar unter:

[www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies](http://www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies).

*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:*

HSBC hat sich der Anwendung und Förderung globaler Standards verpflichtet. Die wichtigsten Schwerpunktbereiche der Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren entsprachen den zehn UNGC-Grundsätzen. Diese Grundsätze stehen in Zusammenhang mit nicht finanziellen Risiken in den Bereichen Menschenrechte, Arbeit, Umweltschutz und Korruptionsbekämpfung. HSBC gehört darüber hinaus zu den Unterzeichnern der UN Principles for Responsible Investment. Diese bildeten den Rahmen für Ermittlung und Management von Nachhaltigkeitsrisiken beim Investmentansatz von HSBC. Von Unternehmen, in die der Teilfonds investierte, wurde erwartet, dass sie die Anforderungen des UNGC und der damit verbundenen Standards erfüllen. Unternehmen, die belegbar gegen einen der zehn Grundsätze des UNGC verstießen, wurden systematisch ausgeschlossen. Der Teilfonds führte verstärkte Due-Diligence-Prüfungen bei Unternehmen durch, die als nicht konform mit den Prinzipien des UNGC angesehen wurden oder die nach den unternehmenseigenen ESG Ratings von HSBC als risikoreich angesehen wurden. Darüber hinaus wurden die Unternehmen nach internationalen Standards wie den OECD-Leitsätzen bewertet.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen. Hierbei gelten spezifische von der EU definierte Kriterien.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*



### **Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Der Teilfonds berücksichtigte die folgenden PAI, indem er sie als Nachhaltigkeitsindikatoren beobachtete:

- Treibhausgasintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1 und Scope 2)
- Verstöße gegen die UNGC- und OECD-Grundsätze
- Anteil der Investitionen mit Beteiligung an umstrittenen Waffen
- Treibhausgasintensität von staatlichen Emittenten

Der Ansatz zur Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen beinhaltete unter anderem, dass HSBC das Engagement der Unternehmen für den Übergang zu CO<sub>2</sub>-armen Wirtschaften, die zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern sowie die Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette prüfte, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails. Ebenfalls berücksichtigt wurde das Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit den Bereichen demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.

Das Screening führte dazu, dass HSBC nicht in bestimmte Unternehmen und Emittenten investierte.



## Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der Investitionen** entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden: basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des Bezugszeitraums zum 31.03.2024

| Größte Investitionen  | Sektor         | % der Vermögenswerte | Land  |
|---|----------------|----------------------|---|
| HSBC GLB-GLB BD TL RT-ZC USD 10841441                         | Finanzen       | 3,91 %               | Vereinigtes Königreich von Großbritannien und Nordirland. |
| Government Of The United States Of America 0,375 % 31.01.2026 | Staatsanleihen | 2,81 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| Government Of The United States Of America 0,5 % 28.02.2026   | Staatsanleihen | 2,35 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| Government Of The United States Of America 3,0 % 15.07.2025   | Staatsanleihen | 2,10 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| Government Of The United States Of America 4,625 % 30.09.2028 | Staatsanleihen | 1,52 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| Government Of Canada 3,75 % 01.05.2025                        | Staatsanleihen | 1,48 %               | Kanada  |
| Government Of The United States Of America 3,375 % 15.05.2033 | Staatsanleihen | 1,46 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| Government Of The United States Of America 5,0 % 30.09.2025   | Staatsanleihen | 1,40 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| Government Of The United States Of America 4,625 % 30.06.2025 | Staatsanleihen | 1,38 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| Government Of The United States Of America 3,875 % 15.08.2033 | Staatsanleihen | 1,37 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| Government Of The United States Of America 4,0 % 29.02.2028   | Staatsanleihen | 1,32 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| Government Of The United States Of America 2,25 % 15.02.2052  | Staatsanleihen | 1,21 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| Government Of The United States Of America 1,875 % 28.02.2027 | Staatsanleihen | 1,20 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| Government Of United Kingdom 3,75 % 22.10.2053                | Staatsanleihen | 1,11 %               | Vereinigtes Königreich von Großbritannien und Nordirland. |
| Government Of Japan 0,2 % 20.03.2028                          | Staatsanleihen | 1,03 %               | Japan   |

Barmittel und Derivate wurden nicht berücksichtigt

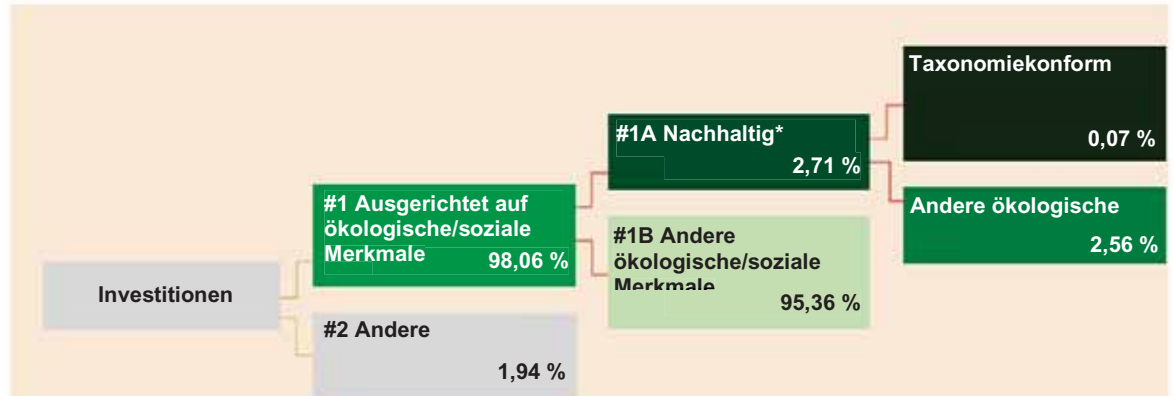


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

2,71 % des Portfolios waren in nachhaltige Vermögenswerte investiert.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

### ● *Wie sah die Vermögensallokation aus?*



**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**#2 Andere Investitionen** umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

\* Ein Unternehmen oder Emittent, das bzw. der als nachhaltige Investition angesehen wird, kann sowohl zu einem sozialen als auch zu einem ökologischen Ziel beitragen, das an der EU-Taxonomie ausgerichtet sein kann oder nicht. Die Zahlen in der obigen Grafik berücksichtigen dies. Jedoch darf eine Gesellschaft oder ein Emittent unter dem Punkt der nachhaltigen Investitionen (#1A Nachhaltige Investitionen) nur einmal erfasst werden.

Die Prozentzahlen von taxonomiekonformen Investitionen und Andere ökologische Merkmale stimmen aufgrund der unterschiedlichen Berechnungsmethoden für nachhaltige Investitionen und taxonomiekonforme Investitionen nicht mit #1A Nachhaltige Investitionen überein.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

| Sektor / Teilsektor                              | % der Vermögenswerte |
|--|----------------------|
| Staatsanleihen                                   | 94,93 %              |
| Andere   | 3,07 %               |
| Barmittel und Derivate                           | 0,67 %               |
| Finanzen   | 0,67 %               |
| Versorger  | 0,21 %               |
| <i>Stromversorgungsbetriebe</i>                  | 0,08 %               |
| <i>Erdgas</i>                                    | 0,01 %               |
| <i>Multi-Versorger</i>                           | 0,11 %               |
| Industriegüter                                   | 0,13 %               |
| Kommunikationsdienstleistungen                   | 0,08 %               |
| Immobilien                                       | 0,08 %               |
| Zyklische Konsumgüter                            | 0,06 %               |
| Energie  | 0,06 %               |
| <i>Integrierter Öl- und Gaskonzern</i>           | 0,05 %               |
| <i>Exploration und Produktion von Öl und Gas</i> | 0,00 %               |
| Grundstoffe                                      | 0,02 %               |
| Gesundheitswesen                                 | 0,01 %               |
| Informationstechnologie                          | 0,01 %               |
| Basiskonsumgüter                                 | 0,00 %               |
| Summe  | 100,00 %             |



● **Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?**

Der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen ist in den obigen Feldern zur Vermögensallokation ersichtlich.

● **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?**

Ja:
  In fossiles Gas
  In Kernenergie

Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf vollerneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- Umsatzerlöse, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

**- Investitionsausgaben**

(CapEx), die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen.

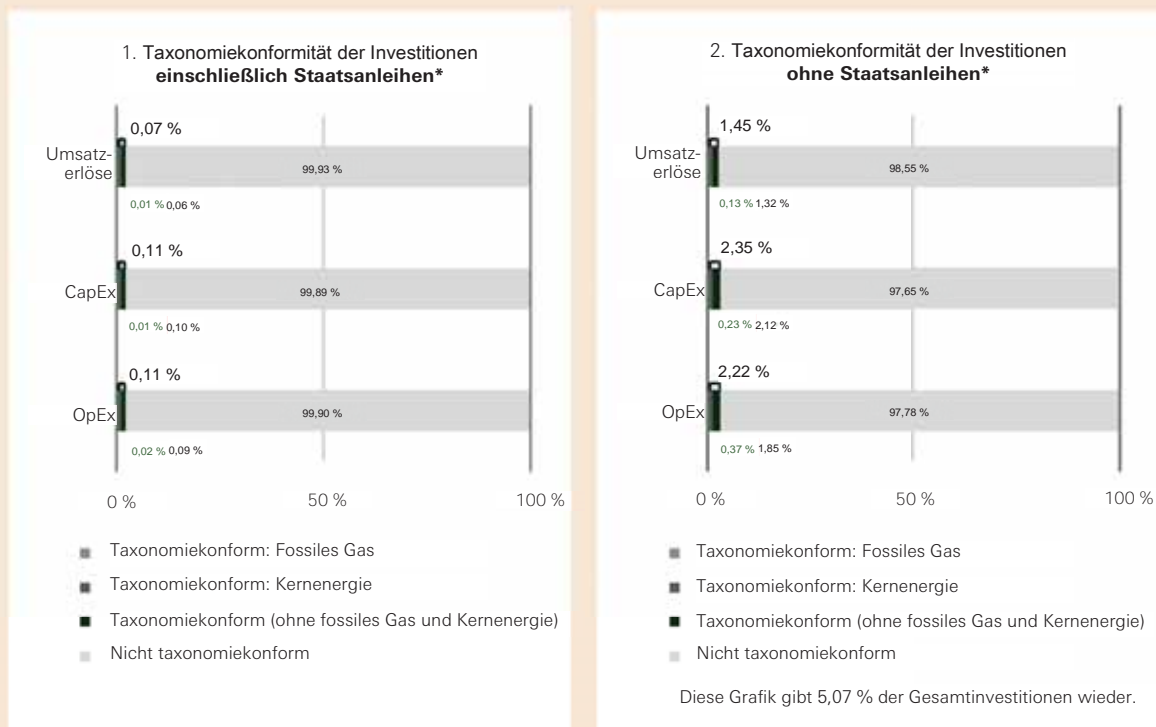
**- Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

**Übergangstätigkeiten**

sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

**Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt das erste Diagramm die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich Staatsanleihen, während das zweite Diagramm die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts ohne Staatsanleihen zeigt.**



\* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

**Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Im Bezugszeitraum betrug der Anteil der Fondsinvestitionen in Übergangstätigkeiten 0,01 % und der Anteil der Investitionen in ermöglichende Tätigkeiten 0,02 %.

**Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

| Indikator   | 2023-2024 | 2022-2023 |
|---|-----------|-----------|
| Umsatz – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                       | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform: Kernenergie                        | 0,01 %    | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie) | 0,06 %    | 0,00 %    |
| Umsatz – Nicht taxonomiekonform                               | 99,93 %   | 100,00 %  |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                        | 0,00 %    | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                         | 0,01 %    | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)  | 0,10 %    | 0,00 %    |
| CAPEX – Nicht taxonomiekonform                                | 99,89 %   | 100,00 %  |
| OPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                         | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                          | 0,02 %    | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)   | 0,09 %    | 0,00 %    |
| OPEX – Nicht taxonomiekonform                                 | 99,90 %   | 100,00 %  |

Da es sich erst um den zweiten Berichtszeitraum des Teilfonds handelt, ist ein Vergleich mit der Zeit davor nicht erforderlich.



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?**

Der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel war 2,56 %. Der Teilfonds hat sich nicht verpflichtet, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen.



### **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Teilfonds investierte nicht in sozial nachhaltige Anlagen.



### **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

#2 Andere Investitionen umfasst die Finanzinstrumente, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden. In manchen Fällen ist dies auf die Nichtverfügbarkeit von Daten und Unternehmensmaßnahmen zurückzuführen. Diese Positionen unterlagen nach wie vor dem vollständigen Ausschluss-Screening von HSBC und wurden im Hinblick auf verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Prinzipien des UNGC und der OECD geprüft.

Der Teilfonds hielt Barmittel / Barmitteläquivalente (der Prozentsatz der gehaltenen Barmittel ist in der obigen Tabelle der Sektoren/Teilektoren unter der Überschrift „In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?“ ersichtlich) zum Zwecke des Liquiditätsmanagements sowie derivative Finanzinstrumente zum Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements. Barmittel / Barmitteläquivalente und derivative Finanzinstrumente verfügen aufgrund der Art dieser Instrumente über keinen ökologischen oder sozialen Mindestschutz.



### **Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?**

Im Laufe des Berichtszeitraums schloss der Anlageberater unter anderem verbotene Waffen, umstrittene Waffen, Unternehmen, die mehr als 10 % ihres Umsatzes aus Kraftwerkskohle und Energieerzeugung aus Kohle generieren, und Tabakherstellung aus und investierte in Unternehmen mit verantwortungsvollen Geschäftspraktiken gemäß den Prinzipien des UNGC.

Alle Positionen des Portfolios wurden hinsichtlich ihrer individuellen Treibhausgasintensität bewertet, was zu PAI-Scores führte, die im Einklang mit denen des Referenzwerts lagen. Der Teilfonds bewertete auch ESG-Scores mit dem Ergebnis, dass der ESG-Score während des gesamten Berichtszeitraums über dem des Referenzwerts lag.

Darüber hinaus wurden alle Positionen auf Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der OECD untersucht, um Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung innerhalb des Portfolios sicherzustellen.





## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Nicht zutreffend.

- **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?**

Nicht zutreffend.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

Bei den

### **Referenzwerten**

handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen 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.

**Name des Produkts:** HSBC GLOBAL INVESTMENT FUNDS - GLOBAL SHORT DURATION BOND

**Unternehmenskennung (LEI-Code):** 213800OJCTAUAEUXXF30

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

| <input checked="" type="checkbox"/> <input checked="" type="checkbox"/> <input type="checkbox"/> <b>Ja</b>   | <input checked="" type="checkbox"/> <input type="checkbox"/> <input checked="" type="checkbox"/> <b>Nein</b>   |
|--|--|
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel</b> getätigt: _ %<br><br><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><br><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit <b>ökologische/soziale Merkmale beworben</b> und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 6,92 % an nachhaltigen Investitionen<br><br><input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><br><input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><br><input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel |
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel</b> getätigt: _ %  | <input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt</b>  |



### Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Während des Geschäftsjahres zum 31. März 2024 (der Bezugszeitraum) bewarb der Teilfonds Folgendes:

- Der Teilfonds prüfte und analysierte alle Unternehmen oder Emittenten im Hinblick auf ökologische Merkmale, insbesondere physische Risiken durch den Klimawandel und Personalmanagement. Für die zugrunde liegenden E-, S- und G-Säulen wurden ein Screening sowie ein Vergleich mit dem für den Teilfonds definierten Referenzwert durchgeführt. „E“ und „S“ spiegeln die einzelnen Elemente der vom Teilfonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale wider, „G“ die Unternehmensführungspraktiken, die die Interessen von Minderheitsaktionären schützen und eine langfristige nachhaltige Wertschöpfung fördern.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

2. Der Teilfonds berücksichtigte verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Grundsätzen des Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC) und den Leitsätzen für multinationale Unternehmen der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für Unternehmen. Wurden potenzielle Verstöße gegen die Prinzipien des UNGC festgestellt, wurden die Emittenten einer eigenen Due-Diligence-Prüfung hinsichtlich ESG-Themen unterzogen, um festzustellen, ob sie für die Aufnahme in das Portfolio des Teilfonds geeignet sind, und sie auszuschließen, falls sie als ungeeignet erachtet wurden.
3. Der Teilfonds schloss Geschäftstätigkeiten aus, die als umweltschädlich gelten, wie z. B. die Förderung von Kraftwerkskohle und die Kohleverstromung.
4. Der Teilfonds berücksichtigte aktiv ökologische und soziale Aspekte, indem er über unsere Engagement- und Stewardship-Teams Mitwirkung bei Emittenten umsetzte und sein Recht zur Stimmrechtsvertretung wahrnahm.
5. Der Teilfonds schloss Anlagen in umstrittenen Waffen aus.

Die ESG-Scores stammen vom externen ESG-Datenanbieter MSCI. Die Berücksichtigung einzelner (in der nachstehenden Tabelle nummerierter) wichtigster nachteiliger Indikatoren (PAI) drückt sich darin aus, dass der Teilfonds niedrigere Werte als der Referenzwert aufweist. Die bei der Berechnung der PAI-Werte verwendeten Daten stammen von externen Datenanbietern. Sie können auf Unternehmensangaben basieren oder von den Datenanbietern geschätzt werden wo keine solchen Angaben vorliegen. Bitte beachten Sie, dass es nicht immer möglich ist, die Richtigkeit, Aktualität oder Vollständigkeit der von Drittanbietern bereitgestellten Daten zu garantieren.

Der Referenzwert wurde nicht zum Zweck der Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale des Teilfonds bestimmt.

Das Abschneiden der Nachhaltigkeitsindikatoren, die der Teilfonds zur Messung der Erreichung der von ihm beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet, ist in der folgenden Tabelle dargestellt. Es wurde auf das Erreichen eines ESG-Score des Teilfonds hingearbeitet, der über dem vom Teilfonds ausgewählten Referenzindex liegt (ein höherer Score als der Referenzwert bedeutet bessere ESG-Referenzen).

Alle Emittenten haben eine gute Unternehmensführung bewiesen, was sich am PAI-Score 10 unten ablesen lässt.

### ● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

| <b>Indikator</b>   | <b>Teilfonds</b> | <b>Referenzwert</b> |
|--|------------------|---------------------|
| ESG-Score  | 6,66             | 5,87                |
| E-Säule  | 6,88             | 5,42                |
| S-Säule  | 5,77             | 6,39                |
| G-Säule  | 6,27             | 6,43                |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente pro Million Euro Umsatz   | 92,54            | 154,29              |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 0,11 %           | 0,15 %              |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 0,00 %           | 0,03 %              |
| 15. THG-Emissionsintensität - Kennzahl in Kilotonnen pro BIP-Einheit (in Millionen Euro)   | 370,15           | 361,31              |

Die Daten in diesem regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung beziehen sich auf den Stand vom 31. März 2024, basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des am 31. März 2024 endenden Geschäftsjahres.

Referenzwert - Bloomberg Global Aggregate (1-3 Y)

### ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

| Indikator  | Zeitraum<br>zum | Teilfonds | Referenzwert |
|--|-----------------|-----------|--------------|
| ESG-Score  | 31. März 2024   | 6,66      | 5,87         |
|  | 31. März 2023   | 6,61      | 5,99         |
| E-Säule  | 31. März 2024   | 6,88      | 5,42         |
|  | 31. März 2023   | 5,94      | 5,22         |
| S-Säule  | 31. März 2024   | 5,77      | 6,39         |
|  | 31. März 2023   | 6,49      | 6,59         |
| G-Säule  | 31. März 2024   | 6,27      | 6,43         |
|  | 31. März 2023   | 6,28      | 6,02         |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente pro Million Euro Umsatz   | 31. März 2024   | 92,54     | 154,29       |
|  | 31. März 2023   | 102,44    | 148,82       |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 31. März 2024   | 0,11 %    | 0,15 %       |
|  | 31. März 2023   | 0,00 %    | 0,46 %       |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 31. März 2024   | 0,00 %    | 0,03 %       |
|  | 31. März 2023   | 0,00 %    | 0,01 %       |
| 15. THG-Emissionsintensität - Kennzahl in Kilotonnen pro BIP-Einheit (in Millionen Euro)   | 31. März 2024   | 370,15    | 361,31       |
|  | 31. März 2023   | 247,58    | 272,13       |

Da es sich erst um den zweiten regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung handelt, ist kein Vergleich mit vorangegangenen Zeiträumen möglich.

### **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die vom Teilfonds getätigten nachhaltigen Investitionen trugen unter anderem zu folgenden ökologischen Zielen bei:

1. Reduzierung von Treibhausgasemissionen und Verringerung des CO<sub>2</sub>-Fußabdrucks;
2. Übergang zu oder die Nutzung von erneuerbarer Energie.

Der Teilfonds strebt über die Portfoliokonstruktion einen im Vergleich zu den Bestandteilen des Referenzwerts besseren ESG-Gesamtwert des Portfolios an.

### **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Wir bestätigen, dass wir nachhaltige Vermögenswerte darauf geprüft haben, ob sie erhebliche Beeinträchtigungen verursachen können. Dies erfolgte im Rahmen des Standard-Anlageprozesses von HSBC Asset Management (HSBC) und unter Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen.

*Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?*

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 Anlageberater hat alle durch die Offenlegungsverordnung definierten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI) auf ihre Relevanz für den Teilfonds geprüft. Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren legt fest, wie HSBC die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen identifiziert und darauf reagiert, und in welcher Form HSBC Nachhaltigkeitsrisiken berücksichtigt, die sich negativ auf Wertpapiere auswirken können, in die der Teilfonds investiert. HSBC identifizierte in Zusammenarbeit mit externen Screening-Dienstleistern wie Sustainalytics, ISS, MSCI und Trucost Unternehmen und Staaten mit schlechter Bilanz beim Management von ESG-Risiken, und wo solche wesentlichen Risiken identifiziert wurden, führte HSBC zusätzliche Due Diligence-Prüfungen durch. Durch Screening identifizierte Nachhaltigkeitsauswirkungen, einschließlich der relevanten PAI, bildeten einen Schlüsselfaktor beim Anlageentscheidungsprozess.

Der oben beschriebene Ansatz führte dazu, dass unter anderem folgende Faktoren geprüft wurden:

- Engagement der Unternehmen für den Übergang zu CO<sub>2</sub>-armen Wirtschaften, zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern, Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus großen Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails; und
- Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit folgenden Bereichen: demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.

Die spezifischen PAI für diesen Teilfonds waren wie unten beschrieben.

Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsvolles Investieren ist auf der Website verfügbar unter:

[www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies](http://www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies).

*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:*

HSBC hat sich der Anwendung und Förderung globaler Standards verpflichtet. Die wichtigsten Schwerpunktbereiche der Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren entsprachen den zehn UNGC-Grundsätzen. Diese Grundsätze stehen in Zusammenhang mit nicht finanziellen Risiken in den Bereichen Menschenrechte, Arbeit, Umweltschutz und Korruptionsbekämpfung. HSBC gehört darüber hinaus zu den Unterzeichnern der UN Principles for Responsible Investment. Diese bildeten den Rahmen für Ermittlung und Management von Nachhaltigkeitsrisiken beim Investmentansatz von HSBC. Von Unternehmen, in die der Teilfonds investierte, wurde erwartet, dass sie die Anforderungen des UNGC und der damit verbundenen Standards erfüllen. Unternehmen, die belegbar gegen einen der zehn Grundsätze des UNGC verstießen, wurden systematisch ausgeschlossen. Der Teilfonds führte verstärkte Due-Diligence-Prüfungen bei Unternehmen durch, die als nicht konform mit den Prinzipien des UNGC angesehen wurden oder die nach den unternehmenseigenen ESG Ratings von HSBC als risikoreich angesehen wurden. Darüber hinaus wurden die Unternehmen nach internationalen Standards wie den OECD-Leitsätzen bewertet.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen. Hierbei gelten spezifische von der EU definierte Kriterien.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*



### **Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Die vom Teilfonds berücksichtigte wichtigste nachteilige Auswirkungen waren:

- Treibhausgasintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1 und Scope 2)
- Verstöße gegen die UNGC- und OECD-Grundsätze
- Anteil der Investitionen mit Beteiligung an umstrittenen Waffen
- Treibhausgasintensität von staatlichen Emittenten

Der Ansatz zur Berücksichtigung der PAI beinhaltete unter anderem, dass HSBC das Engagement der Unternehmen für den Übergang zu CO<sub>2</sub>-armen Wirtschaften, die zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern sowie die Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette prüfte, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails. Ebenfalls berücksichtigt wurde das Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit den Bereichen demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.

Das Screening führte dazu, dass HSBC nicht in bestimmte Unternehmen und Emittenten investierte.



## Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der Investitionen** entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden: basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des Bezugszeitraums zum 31.03.2024

| Größte Investitionen   | Sektor         | % der Vermögenswerte | Land  |
|--|----------------|----------------------|---|
| Government Of Germany 0,0 %<br>09.10.2026                        | Staatsanleihen | 2,86 %               | Deutschland   |
| Government Of China 3,01 %<br>13.05.2028                         | Staatsanleihen | 1,65 %               | China   |
| Government Of The United States<br>Of America 1,25 % 30.11.2026  | Staatsanleihen | 1,63 %               | Vereinigte Staaten<br>von Amerika                               |
| HSBC GLF-USD ESG LIQ-Y<br>11315951                               | Andere         | 1,62 %               | Irland  |
| Government Of Germany 0,25 %<br>15.02.2027                       | Staatsanleihen | 1,45 %               | Deutschland   |
| Government Of New Zealand<br>4,5 % 15.04.2027                    | Staatsanleihen | 1,41 %               | Neuseeland  |
| Government Of The United States<br>Of America 1,5 % 31.01.2027   | Staatsanleihen | 1,34 %               | Vereinigte Staaten<br>von Amerika                               |
| Natwest Group Plc 3,622 %<br>14.08.2030                          | Finanzen       | 1,24 %               | Vereinigtes Königreich<br>von Großbritannien<br>und Nordirland. |
| Government Of The United States<br>Of America 3,125 % 15.08.2025 | Staatsanleihen | 1,23 %               | Vereinigte Staaten<br>von Amerika                               |
| Government Of China 2,4 %<br>15.07.2028                          | Staatsanleihen | 1,22 %               | China   |
| Government Of The United States<br>Of America 2,0 % 15.11.2026   | Staatsanleihen | 1,10 %               | Vereinigte Staaten<br>von Amerika                               |
| Government Of Germany 2,8 %<br>12.06.2025                        | Staatsanleihen | 1,09 %               | Deutschland   |
| Export-Import Bank of China<br>4,89 % 26.03.2028                 | Staatsanleihen | 1,07 %               | China   |
| National Grid North America, Inc.<br>4,151 % 12.09.2027          | Versorger      | 1,00 %               | Vereinigte Staaten<br>von Amerika                               |
| Government Of Mexico 7,5 %<br>03.06.2027                         | Staatsanleihen | 0,97 %               | Mexiko  |

Barmittel und Derivate wurden nicht berücksichtigt

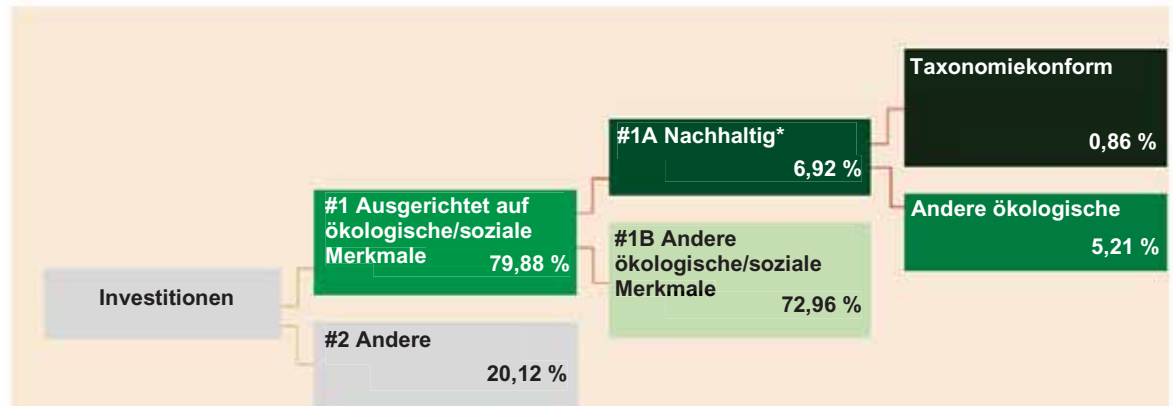


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

6,92 % des Portfolios waren in nachhaltige Vermögenswerte investiert.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

### ● *Wie sah die Vermögensallokation aus?*



**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**#2 Andere Investitionen** umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

\* Ein Unternehmen oder Emittent, das bzw. der als nachhaltige Investition angesehen wird, kann sowohl zu einem sozialen als auch zu einem ökologischen Ziel beitragen, das an der EU-Taxonomie ausgerichtet sein kann oder nicht. Die Zahlen in der obigen Grafik berücksichtigen dies. Jedoch darf eine Gesellschaft oder ein Emittent unter dem Punkt der nachhaltigen Investitionen (#1A Nachhaltige Investitionen) nur einmal erfasst werden.

Die Prozentzahlen von taxonomiekonformen Investitionen und Andere ökologische Merkmale stimmen aufgrund der unterschiedlichen Berechnungsmethoden für nachhaltige Investitionen und taxonomiekonforme Investitionen nicht mit #1A Nachhaltige Investitionen überein.



**In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

| Sektor / Teilsektor                              | % der Vermögenswerte |
|--|----------------------|
| Staatsanleihen                                   | 33,08 %              |
| Finanzen   | 25,78 %              |
| Andere   | 25,52 %              |
| <i>Erdgas</i>                                    | 0,02 %               |
| <i>Lagerung und Transport von Öl und Gas</i>     | 0,08 %               |
| Versorger  | 3,16 %               |
| <i>Stromversorgungsbetriebe</i>                  | 1,45 %               |
| <i>Erdgas</i>                                    | 0,84 %               |
| <i>Multi-Versorger</i>                           | 0,56 %               |
| Zyklische Konsumgüter                            | 2,98 %               |
| Immobilien                                       | 2,21 %               |
| Kommunikationsdienstleistungen                   | 2,05 %               |
| Industriegüter                                   | 1,94 %               |
| Energie  | 1,36 %               |
| <i>Integrierter Öl- und Gaskonzern</i>           | 0,79 %               |
| <i>Exploration und Produktion von Öl und Gas</i> | 0,45 %               |
| <i>Lagerung und Transport von Öl und Gas</i>     | 0,12 %               |
| Gesundheitswesen                                 | 1,10 %               |
| Grundstoffe                                      | 0,44 %               |
| Barmittel und Derivate                           | 0,31 %               |
| Informationstechnologie                          | 0,07 %               |
| Summe  | 100,00 %             |



**Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?**

Der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen ist in den obigen Feldern zur Vermögensallokation ersichtlich.

**Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?**

Ja:
   
 In fossiles Gas
   
 In Kernenergie
   
 Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

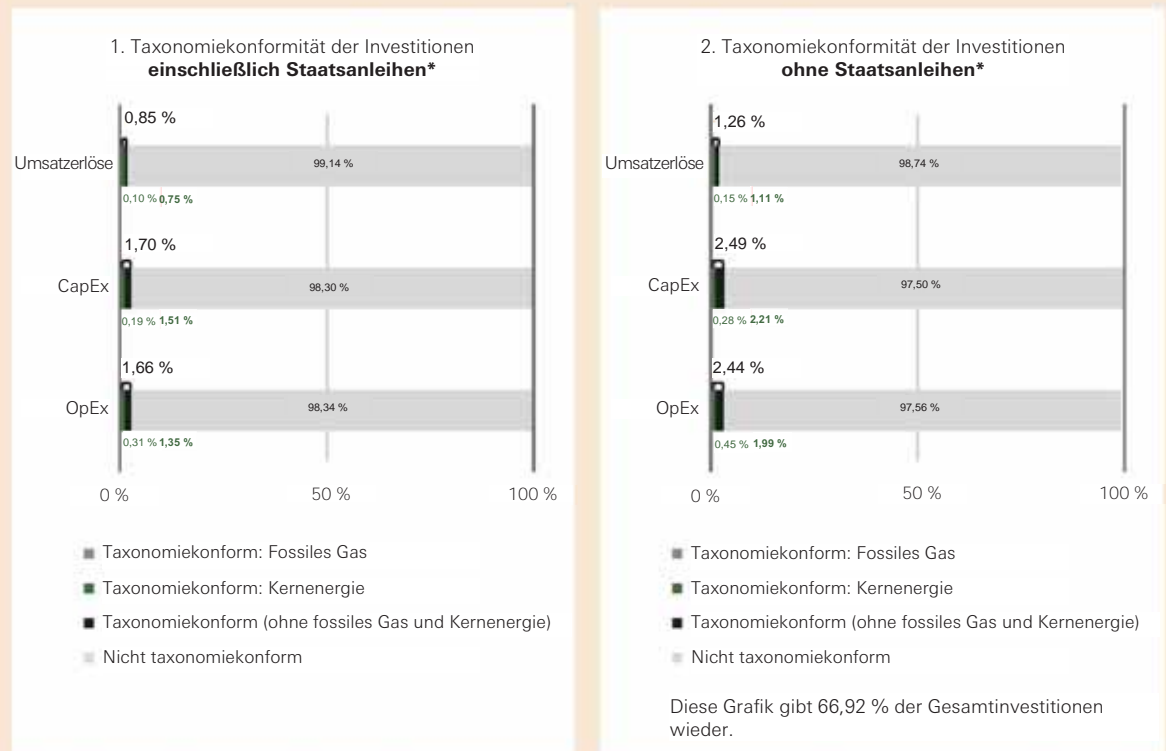
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen.

- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

**Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

**Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonmiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt das erste Diagramm die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich Staatsanleihen, während das zweite Diagramm die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts ohne Staatsanleihen zeigt.**



\* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Im Bezugszeitraum betrug der Anteil der Fondsinvestitionen in Übergangstätigkeiten 0,10 % und der Anteil der Investitionen in ermöglichende Tätigkeiten 0,33 %.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

| Indikator   | 2023-2024 | 2022-2023 |
|---|-----------|-----------|
| Umsatz – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                       | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform: Kernenergie                        | 0,10 %    | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie) | 0,75 %    | 0,00 %    |
| Umsatz – Nicht taxonomiekonform                               | 99,14 %   | 100,00 %  |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                        | 0,00 %    | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                         | 0,19 %    | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)  | 1,51 %    | 0,00 %    |
| CAPEX – Nicht taxonomiekonform                                | 98,30 %   | 100,00 %  |
| OPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                         | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                          | 0,31 %    | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)   | 1,35 %    | 0,00 %    |
| OPEX – Nicht taxonomiekonform                                 | 98,34 %   | 100,00 %  |

Da es sich erst um den zweiten Berichtszeitraum des Teilfonds handelt, ist ein Vergleich mit der Zeit davor nicht erforderlich.



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?

Der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel war 5,21 %. Der Teilfonds hat sich nicht verpflichtet, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen.



## Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Teilfonds investierte nicht in sozial nachhaltige Anlagen.



## Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

#2 Andere Investitionen umfasst die Finanzinstrumente, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden. In manchen Fällen ist dies auf die Nichtverfügbarkeit von Daten und Unternehmensmaßnahmen zurückzuführen. Diese Positionen unterlagen nach wie vor dem vollständigen Ausschluss-Screening von HSBC und wurden im Hinblick auf verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Prinzipien des UNGC und der OECD geprüft.

Der Teilfonds hielt Barmittel / Barmitteläquivalente (der Prozentsatz der gehaltenen Barmittel ist in der obigen Tabelle der Sektoren/Teilektoren unter der Überschrift „In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?“ ersichtlich) zum Zwecke des Liquiditätsmanagements sowie derivative Finanzinstrumente zum Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements. Barmittel / Barmitteläquivalente und derivative Finanzinstrumente verfügen aufgrund der Art dieser Instrumente über keinen ökologischen oder sozialen Mindestschutz.



## Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Im Laufe des Berichtszeitraums schloss der Anlageberater unter anderem verbotene Waffen, umstrittene Waffen, Unternehmen, die mehr als 10 % ihres Umsatzes aus Kraftwerkskohle und Energieerzeugung aus Kohle generieren, und Tabakherstellung aus und investierte in Unternehmen mit verantwortungsvollen Geschäftspraktiken gemäß den Prinzipien des UNGC.

Alle Positionen des Portfolios wurden hinsichtlich ihrer individuellen Treibhausgasintensität bewertet, was zu PAI-Scores führte, die im Einklang mit denen des Referenzwerts lagen. Der Teilfonds bewertete auch ESG-Scores mit dem Ergebnis, dass der ESG-Score während des gesamten Berichtszeitraums über dem des Referenzwerts lag.

Darüber hinaus wurden alle Positionen auf Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der OECD untersucht, um Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung innerhalb des Portfolios sicherzustellen.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Nicht zutreffend.

- **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?**

Nicht zutreffend.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen 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.

Name des Produkts: HSBC GLOBAL INVESTMENT FUNDS - ULTRA SHORT DURATION BOND

Unternehmenskennung (LEI-Code): 213800K751A281KO4P97

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

| Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?  |  |
|--|--|
| <input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> Ja  | <input type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> Nein  |
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel</b> getätigt: _ %<br><br><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><br><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit <b>ökologische/soziale Merkmale beworben</b> und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 9,12 % an nachhaltigen Investitionen<br><br><input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><br><input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><br><input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel |
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel</b> getätigt: _ %  | <input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>ökologische/soziale Merkmale beworben</b> , aber keine <b>nachhaltigen Investitionen</b> getätigt  |



### Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Während des Geschäftsjahres zum 31. März 2024 (der Bezugszeitraum) bewarb der Teilfonds die folgenden Merkmale:

- Der Teilfonds investierte in Wertpapiere, die Klimaschutz- oder umweltschutzbezogene Projekte unterstützten.
- Der Teilfonds berücksichtigte verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Grundsätzen des Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC) und den Leitsätzen für multinationale Unternehmen der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für Unternehmen. Wurden potenzielle Verstöße gegen die Prinzipien des UNGC festgestellt, wurden die Emittenten einer eigenen Due-Diligence-Prüfung hinsichtlich ESG-Themen unterzogen, um festzustellen, ob sie für die Aufnahme in das Portfolio des Teilfonds geeignet sind, und sie auszuschließen, falls sie als ungeeignet erachtet wurden.
- Der Teilfonds schloss Geschäftstätigkeiten aus, die als umweltschädlich gelten, wie z. B. die Förderung von Kraftwerkskohle und die Kohleverstromung.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

4. Der Teilfonds prüfte und analysierte alle Unternehmen oder Emittenten im Hinblick auf ökologische Merkmale, insbesondere physische Risiken durch den Klimawandel und Personalmanagement.
5. Der Teilfonds berücksichtigte aktiv ökologische und soziale Aspekte, indem er über unsere Engagement- und Stewardship-Teams Mitwirkung bei Emittenten umsetzte, wo HSBC Asset Management dies für angemessen hielt.
6. Der Teilfonds schloss nach entsprechender Analyse Anlagen in umstrittenen Waffen aus.

Die auf ESG und Nachhaltigkeitsindikatoren bezogenen Scores werden anhand der proprietären Methodik von HSBC Asset Management und externer ESG-Datenanbieter berechnet. Wir verwenden ESG-Scores von Drittanbietern (z. B. ESG-Scores von MSCI) und haben auch eigene Scores entwickelt, um unsere eigene Sicht der ESG-Risiken und -Chancen widerzuspiegeln. Wir haben eine maßgeschneiderte Branchensegmentierung entwickelt (abgeleitet vom MSCI Global Industry Classification Standard), bei der wir die Wesentlichkeit der wichtigsten E-, S- und G-Faktoren von MSCI auf einer sektoralen Basis neu bewerten und eine sektorspezifische HSBC-ESG-Gewichtung erstellen.

Die Berücksichtigung einzelner wichtigster nachteiliger Auswirkungen (PAI) wird in der nachstehenden Tabelle anhand ihrer Nummerierung im Vergleich zum Referenzwert angegeben. Die bei der Berechnung der PAI-Werte verwendeten Daten stammen von externen Datenanbietern. Sie können auf Unternehmens-/Emittentenangaben basieren oder von den Datenanbietern geschätzt werden, wo keine solchen Angaben vorliegen. Bitte beachten Sie, dass es nicht immer möglich ist, die Richtigkeit, Aktualität oder Vollständigkeit der von Drittanbietern bereitgestellten Daten zu garantieren. Der Referenzwert wurde für den Marktvergleich herangezogen, diente aber nicht der Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale des Teilfonds.

Das Abschneiden der Nachhaltigkeitsindikatoren, die der Teilfonds zur Messung der Erreichung der von ihm beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet, ist in der folgenden Tabelle dargestellt. Es wurde auf das Erreichen eines ESG-Score des Teilfonds hingearbeitet, der über dem vom Teilfonds ausgewählten Referenzindex liegt (ein höherer Score als der Referenzwert bedeutet bessere ESG-Referenzen).

Alle Unternehmen/Emittenten haben eine gute Unternehmensführung bewiesen, was sich am PAI-Score 10 unten ablesen lässt.

### ● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

| <b>Indikator</b>   | <b>Teilfonds</b> | <b>Referenzwert</b> |
|--|------------------|---------------------|
| ESG-Score  | 7,03             | 6,81                |
| E-Säule  | 7,31             | 7,82                |
| S-Säule  | 4,89             | 4,83                |
| G-Säule  | 5,97             | 5,83                |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente pro Million Euro Umsatz   | 77,00            | 71,52               |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 1,12 %           | 0,17 %              |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 0,00 %           | 0,00 %              |

Die Daten in diesem regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung beziehen sich auf den Stand vom 31. März 2024, basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des am 31. März 2024 endenden Geschäftsjahres.

Referenzwert - Bloomberg US Corporate (1-3 Y) (Auflegung am 28.11.2003)

**... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

| Indikator  | Zeitraum zum  | Teilfonds | Referenzwert |
|--|---------------|-----------|--------------|
| ESG-Score  | 31. März 2024 | 7,03      | 6,81         |
|  | 31. März 2023 | 7,05      | 6,75         |
| E-Säule  | 31. März 2024 | 7,31      | 7,82         |
|  | 31. März 2023 | 7,53      | 7,34         |
| S-Säule  | 31. März 2024 | 4,89      | 4,83         |
|  | 31. März 2023 | 4,90      | 4,80         |
| G-Säule  | 31. März 2024 | 5,97      | 5,83         |
|  | 31. März 2023 | 5,95      | 5,74         |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente pro Million Euro Umsatz   | 31. März 2024 | 77,00     | 71,52        |
|  | 31. März 2023 | 103,43    | 177,39       |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 31. März 2024 | 1,12 %    | 0,17 %       |
|  | 31. März 2023 | 1,82 %    | 3,02 %       |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 31. März 2024 | 0,00 %    | 0,00 %       |
|  | 31. März 2023 | 0,00 %    | 0,00 %       |

Da es sich erst um den zweiten regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung handelt, ist kein Vergleich mit vorangegangenen Zeiträumen möglich.

**Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die vom Teilfonds getätigten nachhaltigen Investitionen trugen unter anderem zu folgenden ökologischen Zielen bei:

1. Reduzierung von Treibhausgasemissionen und Verringerung des CO<sub>2</sub>-Fußabdrucks;
2. Übergang zu oder die Nutzung von erneuerbarer Energie.

Der Teilfonds identifizierte und analysierte ESG-Referenzen eines Unternehmens als wesentlichen Bestandteil des Anlageentscheidungsprozesses für die Portfoliokonstruktion mit dem Ziel, Nachhaltigkeitsrisiken zu reduzieren und Renditen zu steigern. Der Anlageberater zielt darauf ab, durch Berücksichtigung der ESG-Referenzen potenzieller Investitionen einen besseren ESG-Score zu erzielen als der Referenzwert.

**Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Wir bestätigen, dass wir nachhaltige Vermögenswerte darauf geprüft haben, ob sie erhebliche Beeinträchtigungen verursachen können. Dies erfolgte im Rahmen des Standard-Anlageprozesses von HSBC Asset Management (HSBC) und unter Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen.

*Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?*

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 Anlageberater hat alle durch die Offenlegungsverordnung definierten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI) auf ihre Relevanz für den Teilfonds geprüft. Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren legt fest, wie HSBC die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen identifiziert und darauf reagiert, und in welcher Form HSBC Nachhaltigkeitsrisiken berücksichtigt, die sich negativ auf Wertpapiere auswirken können, in die der Teilfonds investiert. HSBC identifizierte in Zusammenarbeit mit externen Screening-Dienstleistern wie Sustainalytics, ISS, MSCI und Trucost Unternehmen und Staaten mit schlechter Bilanz beim Management von ESG-Risiken, und wo solche wesentlichen Risiken identifiziert wurden, führte HSBC zusätzliche Due Diligence-Prüfungen durch. Durch Screening identifizierte Nachhaltigkeitsauswirkungen, einschließlich der relevanten PAI, bildeten einen Schlüsselfaktor beim Anlageentscheidungsprozess.

Der oben beschriebene Ansatz führte dazu, dass unter anderem folgende Faktoren geprüft wurden:

- Engagement der Unternehmen für den Übergang zu CO<sub>2</sub>-armen Wirtschaften, zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern, Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus großen Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails; und
- Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit folgenden Bereichen: demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.

Die spezifischen PAI für diesen Teilfonds waren wie unten beschrieben.

Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsvolles Investieren ist auf der Website verfügbar unter:

[www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies](http://www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies).

*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:*

HSBC hat sich der Anwendung und Förderung globaler Standards verpflichtet. Die wichtigsten Schwerpunktbereiche der Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren entsprachen den zehn UNGC-Grundsätzen. Diese Grundsätze stehen in Zusammenhang mit nicht finanziellen Risiken in den Bereichen Menschenrechte, Arbeit, Umweltschutz und Korruptionsbekämpfung. HSBC gehört darüber hinaus zu den Unterzeichnern der UN Principles for Responsible Investment. Diese bildeten den Rahmen für Ermittlung und Management von Nachhaltigkeitsrisiken beim Investmentansatz von HSBC. Von Unternehmen, in die der Teilfonds investierte, wurde erwartet, dass sie die Anforderungen des UNGC und der damit verbundenen Standards erfüllen. Unternehmen, die belegbar gegen einen der zehn Grundsätze des UNGC verstießen, wurden systematisch ausgeschlossen. Der Teilfonds führte verstärkte Due-Diligence-Prüfungen bei Unternehmen durch, die als nicht konform mit den Prinzipien des UNGC angesehen wurden oder die nach den unternehmenseigenen ESG Ratings von HSBC als risikoreich angesehen wurden. Darüber hinaus wurden die Unternehmen nach internationalen Standards wie den OECD-Leitsätzen bewertet.



In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen. Hierbei gelten spezifische von der EU definierte Kriterien.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*



### **Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Die vom Teilfonds berücksichtigte wichtigste nachteilige Auswirkungen waren:

- Treibhausgasintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1 und Scope 2)
- Verstöße gegen die UNGC- und OECD-Grundsätze
- Anteil der Investitionen mit Beteiligung an umstrittenen Waffen

Der Ansatz zur Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen beinhaltete unter anderem, dass HSBC das Engagement der Unternehmen für den Übergang zu kohlenstoffarmem Wirtschaften, die zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern sowie die Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette prüfte, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails. Ebenfalls berücksichtigt wurde das Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit den Bereichen demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.

Das Screening führte dazu, dass HSBC nicht in bestimmte Unternehmen und Emittenten investierte.



## Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der Investitionen** entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden: basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des Bezugszeitraums zum 31.03.2024

| Größte Investitionen   | Sektor                         | % der Vermögenswerte | Land  |
|--|--------------------------------|----------------------|---|
| HSBC Global Investment Funds SICAV - Global Investment Grade Securitised Credit Bond ZC Capitalisation | Andere                         | 4,96 %               | Luxemburg   |
| Government Of The United States Of America Frn 31.10.2025  | Staatsanleihen                 | 1,77 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| Reckitt Benckiser Treasury Services Plc 2,75 % 26.06.2024  | Finanzen                       | 1,27 %               | Vereinigtes Königreich von Großbritannien und Nordirland. |
| Athene Global Funding Frn 24.05.2024   | Finanzen                       | 1,11 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| Massmutual Global Funding li Frn 10.07.2026  | Finanzen                       | 0,87 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| New York Life Global Funding Frn 02.04.2026  | Finanzen                       | 0,87 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| Dbs Group Holdings Ltd Frn 22.11.2024  | Finanzen                       | 0,82 %               | Singapur  |
| Emd Finance Llc 3,25 % 19.03.2025  | Gesundheitswesen               | 0,80 %               | Deutschland   |
| Vodafone Group Plc 4,125 % 30.05.2025  | Kommunikationsdienstleistungen | 0,80 %               | Vereinigtes Königreich von Großbritannien und Nordirland. |
| Banque Federative Du Credit Mutuel Societe Anonyme Frn 13.07.2026                                      | Finanzen                       | 0,77 %               | Frankreich  |
| DBGS 2018-BIOD A 10421417  | Andere                         | 0,77 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| Hewlett Packard Enterprise Company 5,9 % 01.10.2024  | Informationstechnologie        | 0,77 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| Credit Agricole S.a. 3,875 % 15.04.2024  | Finanzen                       | 0,76 %               | Frankreich  |
| Capital One Financial Corporation 6,6816 % 09.05.2025  | Finanzen                       | 0,75 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| At&t Inc. Frn 12.06.2024   | Kommunikationsdienstleistungen | 0,66 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |

Barmittel und Derivate wurden nicht berücksichtigt

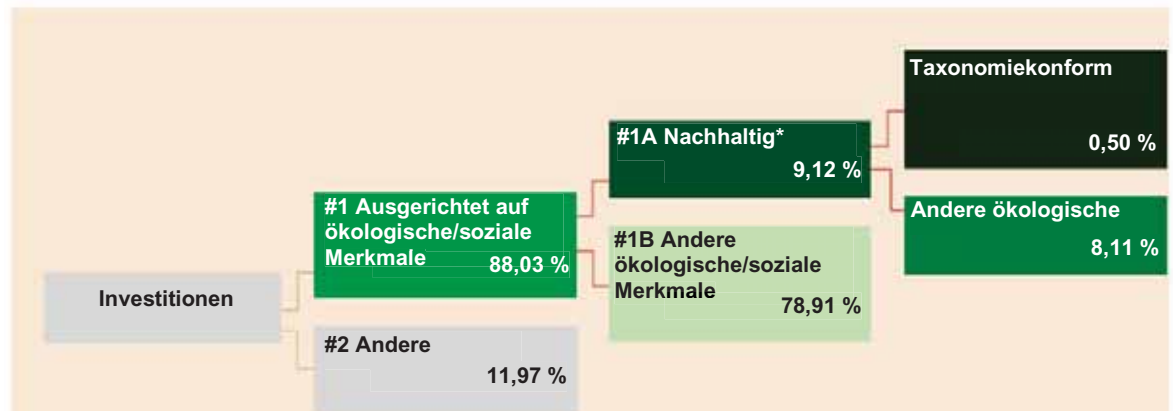


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

9,12 % des Portfolios waren in nachhaltige Vermögenswerte investiert.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

### ● *Wie sah die Vermögensallokation aus?*



**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**#2 Andere Investitionen** umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

\* Ein Unternehmen oder Emittent, das bzw. der als nachhaltige Investition angesehen wird, kann sowohl zu einem sozialen als auch zu einem ökologischen Ziel beitragen, das an der EU-Taxonomie ausgerichtet sein kann oder nicht. Die Zahlen in der obigen Grafik berücksichtigen dies. Jedoch darf eine Gesellschaft oder ein Emittent unter dem Punkt der nachhaltigen Investitionen (#1A Nachhaltige Investitionen) nur einmal erfasst werden.

Die Prozentzahlen von taxonomiekonformen Investitionen und Andere ökologische Merkmale stimmen aufgrund der unterschiedlichen Berechnungsmethoden für nachhaltige Investitionen und taxonomiekonforme Investitionen nicht mit #1A Nachhaltige Investitionen überein.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

| Sektor / Teilsektor                          | % der Vermögenswerte |
|--|----------------------|
| Finanzen                                     | 41,69 %              |
| Andere                                       | 30,62 %              |
| <i>Lagerung und Transport von Öl und Gas</i> | <i>1,10 %</i>        |
| Staatsanleihen                               | 4,73 %               |
| Kommunikationsdienstleistungen               | 4,29 %               |
| Grundstoffe                                  | 4,00 %               |
| Industriegüter                               | 3,28 %               |
| Basiskonsumgüter                             | 3,20 %               |
| Gesundheitswesen                             | 2,36 %               |
| Informationstechnologie                      | 2,30 %               |
| Energie                                      | 1,83 %               |
| <i>Integrierter Öl- und Gaskonzern</i>       | <i>0,88 %</i>        |
| <i>Lagerung und Transport von Öl und Gas</i> | <i>0,95 %</i>        |
| Versorger                                    | 1,52 %               |
| <i>Stromversorgungsbetriebe</i>              | <i>1,30 %</i>        |
| <i>Multi-Versorger</i>                       | <i>0,22 %</i>        |
| Zyklische Konsumgüter                        | 0,72 %               |
| Immobilien                                   | 0,19 %               |
| Barmittel und Derivate                       | -0,72 %              |
| Summe  | 100,00 %             |



**Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?**

Der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen ist in den obigen Feldern zur Vermögensallokation ersichtlich.

● **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?**

Ja:
  In fossiles Gas
  In Kernenergie

Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO2-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

**- Investitionsausgaben**

(CapEx), die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen.

**- Betriebsausgaben**

(OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

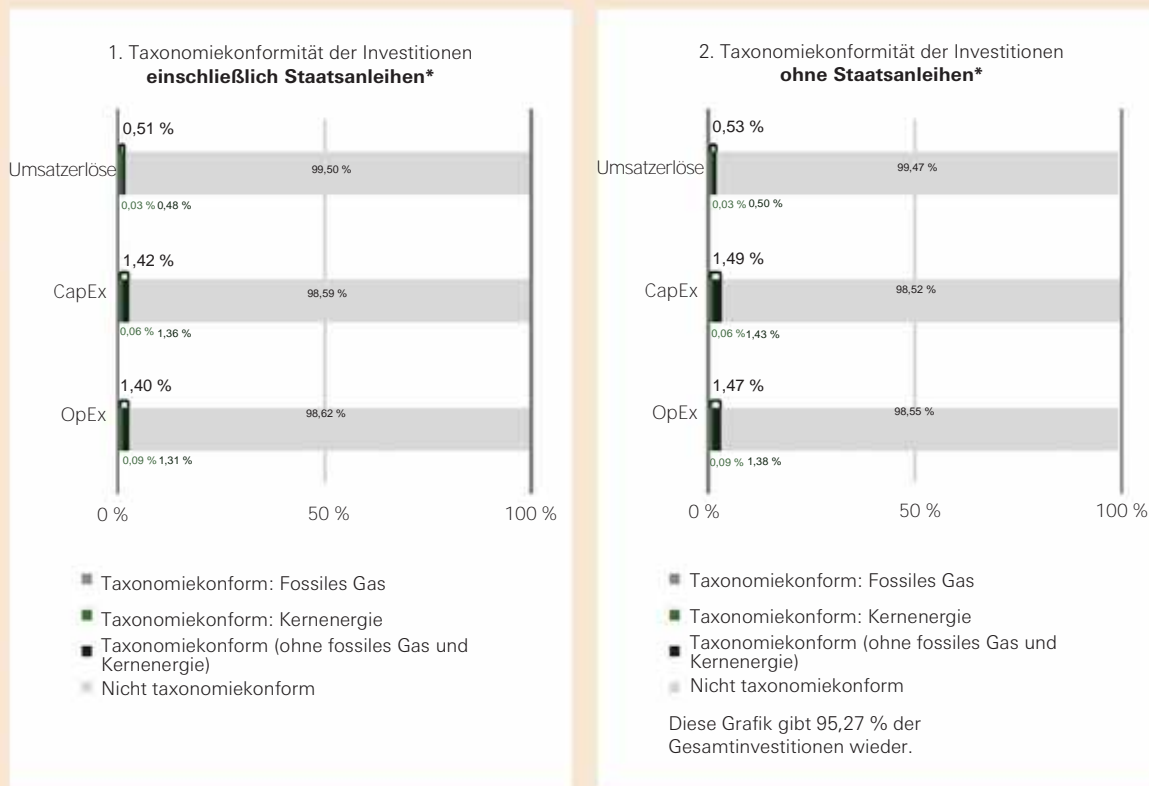
**Übergangstätigkeiten**

sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

**Ermöglichende Tätigkeiten**

wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

**Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonmiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt das erste Diagramm die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich Staatsanleihen, während das zweite Diagramm die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts ohne Staatsanleihen zeigt.**



\* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

**Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Im Bezugszeitraum betrug der Anteil der Fondsinvestitionen in Übergangstätigkeiten 0,05 % und der Anteil der Investitionen in ermöglichende Tätigkeiten 0,31 %.

**Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

| Indikator   | 2023-2024 | 2022-2023 |
|---|-----------|-----------|
| Umsatz – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                       | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform: Kernenergie                        | 0,03 %    | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie) | 0,48 %    | 0,00 %    |
| Umsatz – Nicht taxonomiekonform                               | 99,50 %   | 100,00 %  |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                        | n. z.     | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                         | 0,06 %    | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)  | 1,37 %    | 0,00 %    |
| CAPEX – Nicht taxonomiekonform                                | 98,59 %   | 100,00 %  |
| OPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                         | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                          | 0,09 %    | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)   | 1,31 %    | 0,00 %    |
| OPEX – Nicht taxonomiekonform                                 | 98,62 %   | 100,00 %  |

Da es sich erst um den zweiten Berichtszeitraum des Teilfonds handelt, ist ein Vergleich mit der Zeit davor nicht erforderlich.



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?**

Der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel war 8,11 %. Der Teilfonds hat sich nicht verpflichtet, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen.



### **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Teilfonds investierte nicht in sozial nachhaltige Anlagen.



### **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

#2 Andere Investitionen umfasst die Finanzinstrumente, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden. In manchen Fällen ist dies auf die Nichtverfügbarkeit von Daten und Unternehmensmaßnahmen zurückzuführen. Diese Positionen unterlagen nach wie vor dem vollständigen Ausschluss-Screening von HSBC und wurden im Hinblick auf verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Prinzipien des UNGC und der OECD geprüft.

Der Teilfonds hielt Barmittel / Barmitteläquivalente (der Prozentsatz der gehaltenen Barmittel ist in der obigen Tabelle der Sektoren/Teilektoren unter der Überschrift „In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?“ ersichtlich) zum Zwecke des Liquiditätsmanagements sowie derivative Finanzinstrumente zum Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements. Barmittel / Barmitteläquivalente und derivative Finanzinstrumente verfügen aufgrund der Art dieser Instrumente über keinen ökologischen oder sozialen Mindestschutz.



### **Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?**

Im Laufe des Berichtszeitraums schloss der Anlageberater unter anderem verbotene Waffen, umstrittene Waffen, Unternehmen, die mehr als 10 % ihres Umsatzes aus Kraftwerkskohle und Energieerzeugung aus Kohle generieren, und Tabakherstellung aus und investierte in Unternehmen mit verantwortungsvollen Geschäftspraktiken gemäß den Prinzipien des UNGC.

Nach der Identifizierung des zulässigen Anlageuniversums konstruierte der Anlageberater ein Portfolio, dessen CO<sub>2</sub>-Intensität (berechnet als gewichteter Durchschnitt der CO<sub>2</sub>-Intensitäten der Anlagen des Teilfonds) niedriger ist als der gewichtete Durchschnitt der Bestandteile des Referenzwerts. Dies führte zu einem PAI-Score, der unter dem Referenzwert lag. Der Teilfonds bewertete auch ESG-Scores mit dem Ergebnis, dass der ESG-Score während des gesamten Berichtszeitraums über dem des Referenzwerts lag.

Darüber hinaus wurden alle Positionen auf Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der OECD untersucht, um Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung innerhalb des Portfolios sicherzustellen.



### **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

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?***  
Nicht zutreffend.
- ***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?***  
Nicht zutreffend.
- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?***  
Nicht zutreffend.
- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?***  
Nicht zutreffend.

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen 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.

Name des Produkts: HSBC GLOBAL INVESTMENT FUNDS - US DOLLAR BOND

Unternehmenskennung (LEI-Code): 21380009RWE9DATIW963

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

| Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?   |   |
|---|---|
| <input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> <input type="checkbox"/> <b>Ja</b>  | <input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> <b>Nein</b>  |
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel</b> getätigt: _ %<br><br><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><br><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><br><input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel</b> getätigt: _ % | <input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit <b>ökologische/soziale Merkmale beworben</b> und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 3,71 % an nachhaltigen Investitionen<br><br><input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><br><input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><br><input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel<br><br><input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine <b>nachhaltigen Investitionen getätigt</b> . |



### Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Während des Geschäftsjahres zum 31. März 2024 (der Bezugszeitraum) bewarb der Teilfonds die folgenden Merkmale:

- Der Teilfonds investierte in Wertpapiere, die Klimaschutz- oder umweltschutzbezogene Projekte unterstützten.
- Der Teilfonds berücksichtigte verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Grundsätzen des Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC) und den Leitsätzen für multinationale Unternehmen der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für Unternehmen. Wurden potenzielle Verstöße gegen die Prinzipien des UNGC festgestellt, wurden die Emittenten einer eigenen Due-Diligence-Prüfung hinsichtlich ESG-Themen unterzogen, um festzustellen, ob sie für die Aufnahme in das Portfolio des Teilfonds geeignet sind, und sie auszuschließen, falls sie als ungeeignet erachtet wurden.
- Der Teilfonds schloss Geschäftstätigkeiten aus, die als umweltschädlich gelten, wie z. B. die Förderung von Kraftwerkskohle und die Kohleverstromung.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.



4. Der Teilfonds prüfte und analysierte alle Unternehmen oder Emittenten im Hinblick auf ökologische Merkmale, insbesondere physische Risiken durch den Klimawandel und Personalmanagement.
5. Der Teilfonds berücksichtigte aktiv ökologische und soziale Aspekte, indem er über unsere Engagement- und Stewardship-Teams Mitwirkung bei Emittenten umsetzte, wo HSBC Asset Management dies für angemessen hielt.
6. Der Teilfonds schloss nach entsprechender Analyse Anlagen in umstrittenen Waffen aus.

Die ESG-Scores stammen vom externen ESG-Datenanbieter MSCI. Die Berücksichtigung einzelner wichtigster nachteiliger Auswirkungen (PAI) wird in der nachstehenden Tabelle anhand ihrer Nummerierung im Vergleich zum Referenzwert angegeben. Die bei der Berechnung der PAI-Werte verwendeten Daten stammen von externen Datenanbietern. Sie können auf Emittentenangaben basieren oder von den Datenanbietern geschätzt werden, wo keine solchen Emittentenangaben vorliegen. Bitte beachten Sie, dass es nicht immer möglich ist, die Richtigkeit, Aktualität oder Vollständigkeit der von Drittanbietern bereitgestellten Daten zu garantieren.

Der Referenzwert wurde für den Marktvergleich herangezogen, diente aber nicht der Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale des Teilfonds.

Das Abschneiden der Nachhaltigkeitsindikatoren, die der Teilfonds zur Messung der Erreichung der von ihm beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet, ist in der folgenden Tabelle dargestellt. Es wurde auf das Erreichen eines ESG-Score des Teilfonds hingearbeitet, der über dem vom Teilfonds ausgewählten Referenzindex liegt (ein höherer Score als der Referenzwert bedeutet bessere ESG-Referenzen).

Alle Unternehmen/Emittenten haben eine gute Unternehmensführung bewiesen, was sich am PAI-Score 10 unten ablesen lässt.

### ● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

| <b>Indikator</b>   | <b>Teilfonds</b> | <b>Referenzwert</b> |
|--|------------------|---------------------|
| ESG-Score  | 6,29             | 5,88                |
| E-Säule  | 6,54             | 6,04                |
| S-Säule  | 6,42             | 6,96                |
| G-Säule  | 6,41             | 6,57                |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO2-Äquivalente pro Million Euro Umsatz  | 82,07            | 62,89               |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 0,45 %           | 0,01 %              |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 0,00 %           | 0,00 %              |

Die Daten in diesem regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung beziehen sich auf den Stand vom 31. März 2024, basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des am 31. März 2024 endenden Geschäftsjahres.

Referenzwert – Bloomberg US Aggregate

**... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

| Indikator  | Zeitraum zum  | Teilfonds | Referenzwert |
|--|---------------|-----------|--------------|
| ESG-Score  | 31. März 2024 | 6,29      | 5,88         |
|  | 31. März 2023 | 6,18      | 6,08         |
| E-Säule  | 31. März 2024 | 6,54      | 6,04         |
|  | 31. März 2023 | 6,41      | 6,05         |
| S-Säule  | 31. März 2024 | 6,42      | 6,96         |
|  | 31. März 2023 | 6,17      | 6,33         |
| G-Säule  | 31. März 2024 | 6,41      | 6,57         |
|  | 31. März 2023 | 5,61      | 5,70         |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO2-Äquivalente pro Million Euro Umsatz  | 31. März 2024 | 82,07     | 62,89        |
|  | 31. März 2023 | 68,67     | 260,15       |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 31. März 2024 | 0,45 %    | 0,01 %       |
|  | 31. März 2023 | 0,77 %    | 0,88 %       |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 31. März 2024 | 0,00 %    | 0,00 %       |
|  | 31. März 2023 | 0,00 %    | 0,00 %       |

Da es sich erst um den zweiten regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung handelt, ist kein Vergleich mit vorangegangenen Zeiträumen möglich.

**Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die vom Teilfonds getätigten nachhaltigen Investitionen trugen unter anderem zu folgenden ökologischen Zielen bei:

1. Reduzierung von Treibhausgasemissionen und Verringerung des CO2-Fußabdrucks;
2. Übergang zu oder die Nutzung von erneuerbarer Energie.

Der Fonds bezieht die Identifizierung und Analyse der ESG-Referenzen eines Emittenten als integralen Bestandteil in den Anlageentscheidungsprozess ein, um die Bewertung von Risiken und potenziellen Renditen zu unterstützen.

**Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Wir bestätigen, dass wir nachhaltige Vermögenswerte darauf geprüft haben, ob sie erhebliche Beeinträchtigungen verursachen können. Dies erfolgte im Rahmen des Standard-Anlageprozesses von HSBC Asset Management (HSBC) und unter Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen.

*Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?*

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 Anlageberater hat alle durch die Offenlegungsverordnung definierten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI) auf ihre Relevanz für den Teilfonds geprüft. Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren legt fest, wie HSBC die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen identifiziert und darauf reagiert, und in welcher Form HSBC Nachhaltigkeitsrisiken berücksichtigt, die sich negativ auf Wertpapiere auswirken können, in die der Teilfonds investiert. HSBC identifizierte in Zusammenarbeit mit externen Screening-Dienstleistern wie Sustainalytics, ISS, MSCI und Trucost Unternehmen und Staaten mit schlechter Bilanz beim Management von ESG-Risiken, und wo solche wesentlichen Risiken identifiziert wurden, führte HSBC zusätzliche Due Diligence-Prüfungen durch. Durch Screening identifizierte Nachhaltigkeitsauswirkungen, einschließlich der relevanten PAI, bildeten einen Schlüsselfaktor beim Anlageentscheidungsprozess.

Der oben beschriebene Ansatz führte dazu, dass unter anderem folgende Faktoren geprüft wurden:

- Engagement der Unternehmen für den Übergang zu CO2-armen Wirtschaften, zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern, Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus großen Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails. Ebenfalls berücksichtigt wurde das Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit den Bereichen demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.

Die spezifischen PAI für diesen Teilfonds waren wie unten beschrieben.

Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren ist auf der Website [www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies](http://www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies) verfügbar.

*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:*

HSBC hat sich der Anwendung und Förderung globaler Standards verpflichtet. Die wichtigsten Schwerpunktbereiche der Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren entsprachen den zehn UNGC-Grundsätzen. Diese Grundsätze stehen in Zusammenhang mit nicht finanziellen Risiken in den Bereichen Menschenrechte, Arbeit, Umweltschutz und Korruptionsbekämpfung. HSBC gehört darüber hinaus zu den Unterzeichnern der UN Principles for Responsible Investment. Diese bildeten den Rahmen für Ermittlung und Management von Nachhaltigkeitsrisiken beim Investmentansatz von HSBC. Von Unternehmen, in die der Teilfonds investierte, wurde erwartet, dass sie die Anforderungen des UNGC und der damit verbundenen Standards erfüllen. Unternehmen, die belegbar gegen einen der zehn Grundsätze des UNGC verstießen, wurden systematisch ausgeschlossen. Der Teilfonds führte verstärkte Due-Diligence-Prüfungen bei Unternehmen durch, die als nicht konform mit den Prinzipien des UNGC angesehen wurden oder die nach den unternehmenseigenen ESG Ratings von HSBC als risikoreich angesehen wurden. Darüber hinaus wurden die Unternehmen nach internationalen Standards wie den OECD-Leitsätzen bewertet.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen. Hierbei gelten spezifische von der Union definierte Kriterien.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*



### **Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Der Teilfonds berücksichtigte die folgenden PAI, indem er sie als Nachhaltigkeitsindikatoren beobachtete:

- Treibhausgasintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1 und Scope 2)
- Verstöße gegen die Prinzipien des UNGC und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD)
- Anteil der Investitionen mit Beteiligung an umstrittenen Waffen

Der Ansatz zur Berücksichtigung der PAI beinhaltete unter anderem, dass HSBC das Engagement der Unternehmen für den Übergang zu CO<sub>2</sub>-armen Wirtschaften, die zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern sowie die Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette prüfte, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails. Ebenfalls berücksichtigt wurde das Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit den Bereichen demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.

Das Screening führte dazu, dass HSBC nicht in bestimmte Unternehmen und Emittenten investierte.



## Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der Investitionen** entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden: basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des Bezugszeitraums zum 31.03.2024

| Größte Investitionen  | Sektor         | % der Vermögenswerte | Land                           |
|---|----------------|----------------------|--------------------------------|
| Government Of The United States Of America 0,0 % 14.12.2023   | Staatsanleihen | 4,16 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Government Of The United States Of America 3,625 % 31.05.2028 | Staatsanleihen | 3,34 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Government Of The United States Of America 0,0 % 06.07.2023   | Staatsanleihen | 3,25 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Government Of The United States Of America 0,0 % 22.02.2024   | Staatsanleihen | 3,17 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Government Of The United States Of America 3,75 % 31.05.2030  | Staatsanleihen | 2,51 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Government Of The United States Of America 3,625 % 31.03.2030 | Staatsanleihen | 2,46 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Government Of The United States Of America 4,125 % 31.07.2028 | Staatsanleihen | 2,12 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Government Of The United States Of America 3,25 % 15.05.2042  | Staatsanleihen | 1,83 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Government Of The United States Of America 3,625 % 15.02.2053 | Staatsanleihen | 1,63 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Government Of The United States Of America 3,375 % 15.05.2033 | Staatsanleihen | 1,58 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Government Of The United States Of America 3,625 % 31.03.2028 | Staatsanleihen | 1,40 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Government Of The United States Of America 3,5 % 15.02.2033   | Staatsanleihen | 1,05 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Government Of The United States Of America 3,5 % 30.04.2028   | Staatsanleihen | 0,99 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Government Of The United States Of America 4,375 % 31.08.2028 | Staatsanleihen | 0,87 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Government Of The United States Of America 4,0 % 30.06.2028   | Staatsanleihen | 0,78 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |

Barmittel und Derivate wurden nicht berücksichtigt

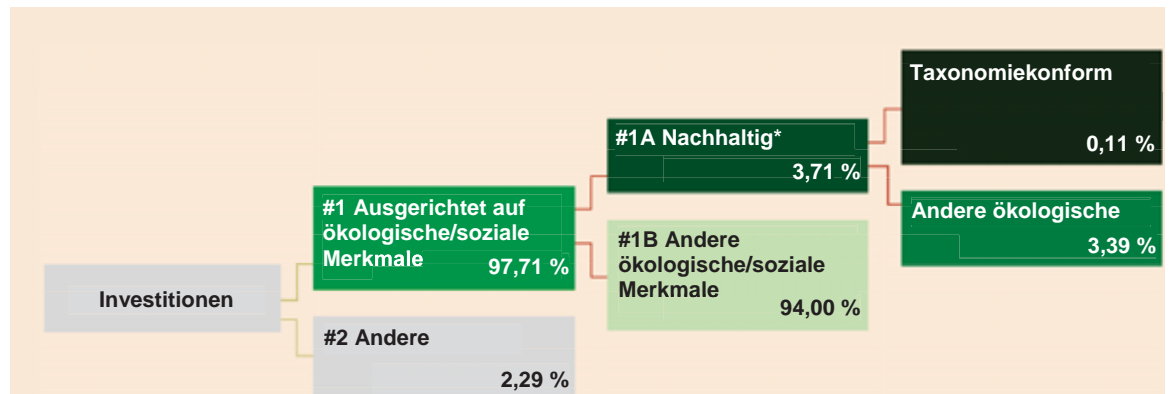


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

3,71 % des Portfolios waren in nachhaltige Vermögenswerte investiert.

Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?



**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**#2 Andere Investitionen** umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

\* Ein Unternehmen oder Emittent, das bzw. der als nachhaltige Investition angesehen wird, kann sowohl zu einem sozialen als auch zu einem ökologischen Ziel beitragen, das an der EU-Taxonomie ausgerichtet sein kann oder nicht. Die Zahlen in der obigen Grafik berücksichtigen dies. Jedoch darf eine Gesellschaft oder ein Emittent unter dem Punkt der nachhaltigen Investitionen (#1A Nachhaltige Investitionen) nur einmal erfasst werden.

Die Prozentzahlen von taxonomiekonformen Investitionen und Andere ökologische Merkmale stimmen aufgrund der unterschiedlichen Berechnungsmethoden für nachhaltige Investitionen und taxonomiekonforme Investitionen nicht mit #1A Nachhaltige Investitionen überein.

### In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

| Sektor / Teilsektor                          | % der Vermögenswerte |
|--|----------------------|
| Staatsanleihen                               | 66,18 %              |
| Andere                                       | 38,68 %              |
| <i>Lagerung und Transport von Öl und Gas</i> | <i>0,52 %</i>        |
| Finanzen                                     | 15,62 %              |
| Industriegüter                               | 1,89 %               |
| Informationstechnologie                      | 1,82 %               |
| Basiskonsumgüter                             | 1,44 %               |
| Immobilien                                   | 1,30 %               |
| Kommunikationsdienstleistungen               | 1,17 %               |
| Versorger                                    | 0,65 %               |
| <i>Multi-Versorger</i>                       | <i>0,59 %</i>        |
| Energie                                      | 0,63 %               |
| <i>Lagerung und Transport von Öl und Gas</i> | <i>0,63 %</i>        |
| Gesundheitswesen                             | 0,38 %               |
| Zyklische Konsumgüter                        | 0,14 %               |
| Grundstoffe                                  | 0,00 %               |
| Barmittel und Derivate                       | -29,90 %             |
| Summe  | 100,00 %             |



## Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

Der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen ist in den obigen Feldern zur Vermögensallokation ersichtlich.

### Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

Ja:
  In fossiles Gas
  In Kernenergie

Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

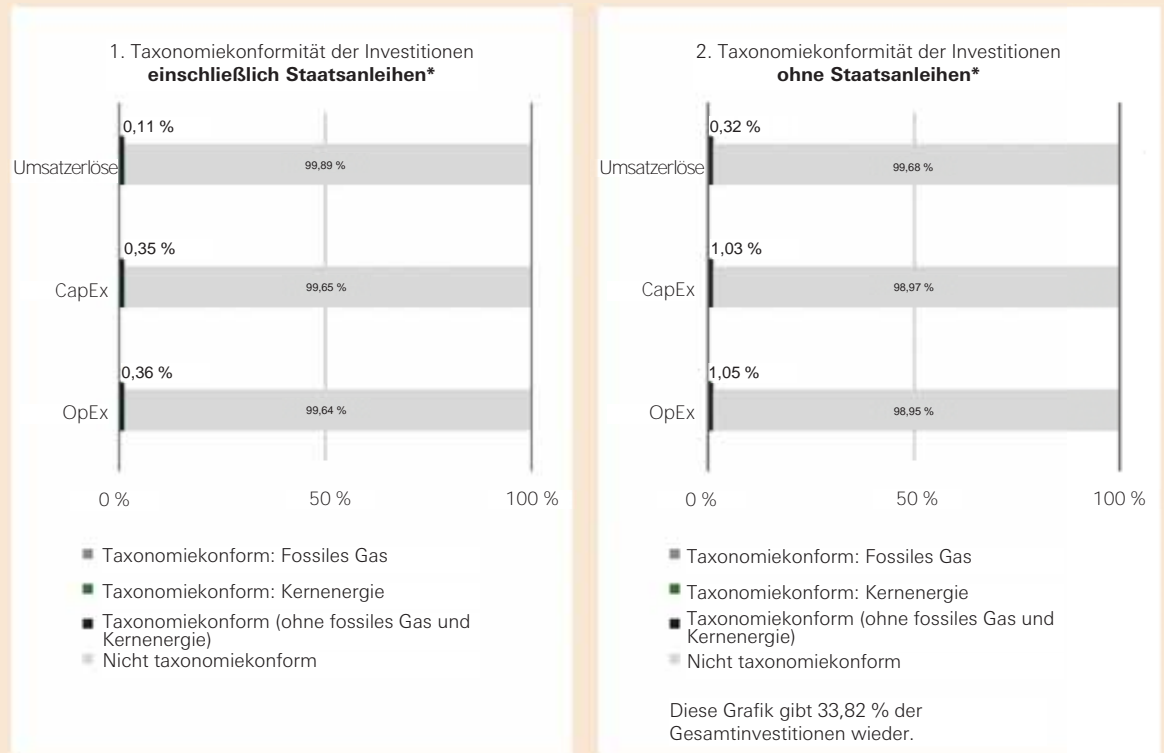
Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

**Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

*Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.*



\* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

### Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?


Im Referenzzeitraum betrug der Anteil der Investitionen des Fonds, die in Übergangstätigkeiten geflossen sind, 0,00 % und der Anteil der Investitionen, die in ermöglichende Tätigkeiten geflossen ist, 0,09 %.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

| Indikator   | 2023-2024 | 2022-2023 |
|---|-----------|-----------|
| Umsatz – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                       | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform: Kernenergie                        | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie) | 0,11 %    | 0,00 %    |
| Umsatz – Nicht taxonomiekonform                               | 99,89 %   | 100,00 %  |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                        | n. z.     | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                         | n. z.     | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)  | 0,35 %    | 0,00 %    |
| CAPEX – Nicht taxonomiekonform                                | 99,65 %   | 100,00 %  |
| OPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                         | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                          | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)   | 0,36 %    | 0,00 %    |
| OPEX – Nicht taxonomiekonform                                 | 99,64 %   | 100,00 %  |

Da es sich erst um den zweiten Berichtszeitraum des Teilfonds handelt, ist ein Vergleich mit der Zeit davor nicht erforderlich.

 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?**

Der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel war 3,39 %. Aufgrund der mangelnden Abdeckung und der fehlenden Daten hat sich der Teilfonds nicht verpflichtet, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen.

 **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Teilfonds investierte nicht in sozial nachhaltige Anlagen.

 **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

#2 Andere Investitionen umfasst die Finanzinstrumente, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden. In manchen Fällen ist dies auf die Nichtverfügbarkeit von Daten und Unternehmensmaßnahmen zurückzuführen. Diese Positionen unterlagen nach wie vor dem vollständigen Ausschluss-Screening von HSBC und wurden im Hinblick auf verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Prinzipien des UNGC und der OECD geprüft.

Der Teilfonds hielt Barmittel / Barmitteläquivalente (der Prozentsatz der gehaltenen Barmittel ist in der obigen Tabelle der Sektoren/Teilsektoren unter der Überschrift „In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?“ ersichtlich) zum Zwecke des Liquiditätsmanagements sowie derivative Finanzinstrumente zum Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements. Barmittel / Barmitteläquivalente und derivative Finanzinstrumente verfügen aufgrund der Art dieser Instrumente über keinen ökologischen oder sozialen Mindestschutz.

 **Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?**

Im Laufe des Berichtszeitraums schloss der Anlageberater unter anderem verbotene Waffen, umstrittene Waffen, Unternehmen, die mehr als 10 % ihres Umsatzes aus Kraftwerkskohle und Energieerzeugung aus Kohle generieren, und Tabakherstellung



aus und investierte in Unternehmen mit verantwortungsvollen Geschäftspraktiken gemäß den Prinzipien des UNGC.

Alle Positionen des Portfolios wurden hinsichtlich ihrer individuellen Treibhausgasintensität bewertet. Der Teilfonds bewertete auch ESG-Scores mit dem Ergebnis, dass der ESG-Score während des gesamten Berichtszeitraums vergleichbar mit dem des Referenzwerts war.

Darüber hinaus wurden alle Positionen auf Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der OECD untersucht, um Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung innerhalb des Portfolios sicherzustellen.



### **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

● ***Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?***

Nicht zutreffend.

● ***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?***

Nicht zutreffend.

● ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?***

Nicht zutreffend.

● ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?***

Nicht zutreffend.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen 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.

**Name des Produkts:** HSBC GLOBAL INVESTMENT FUNDS – CORPORATE EURO BOND FIXED TERM 2027

**Unternehmenskennung (LEI-Code):** 213800HGGJD2679RWB20

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

**Ja**

- Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: \_ %
  - in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
  - in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: \_ %

**Nein**

- Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 22,00 % an nachhaltigen Investitionen
  - mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
  - mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
  - mit einem sozialen Ziel
- Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine **nachhaltigen Investitionen getätigt**



### Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Während des am 31. März 2024 endenden Geschäftsjahres (der Bezugszeitraum) hat der Teilfonds Folgendes beworben:

1. Der Anlageberater war bestrebt, ein Portfolio mit einem höheren ESG-Score (berechnet als gewichteter Durchschnitt der ESG-Scores der Anlagen des Teilfonds) als der gewichtete Durchschnitt der Bestandteile des Referenzwerts zu konstruieren.
2. Der Teilfonds berücksichtigte verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Grundsätzen des Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC) und den

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Leitsätzen für multinationale Unternehmen der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für Unternehmen. Wurden potenzielle Verstöße gegen die Prinzipien des UNGC festgestellt, wurden die Emittenten einer eigenen Due-Diligence-Prüfung hinsichtlich ESG-Themen unterzogen, um festzustellen, ob sie für die Aufnahme in das Portfolio des Teilfonds geeignet sind, und sie auszuschließen, falls sie als ungeeignet erachtet wurden.

3. Der Teilfonds berücksichtigte aktiv ökologische und soziale Aspekte, indem er über unsere Engagement- und Stewardship-Teams Mitwirkung bei Emittenten umsetzte, wo HSBC Asset Management dies für angemessen hielt.

4. Mindestumweltstandards durch den Ausschluss von als umweltschädlich eingestuften Geschäftstätigkeiten, wie z. B. die Förderung von Kraftwerkskohle und die Kohleverstromung.

### ● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

| Indikator  | Teilfonds | Referenzwert |
|--|-----------|--------------|
| ESG-Score  | 7,23      | 6,84         |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 0,00 %    | 0,23 %       |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 0,00 %    | 0,00 %       |

Die Daten in diesem regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung beziehen sich auf den Stand vom 31. März 2024, basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des am 31. März 2024 endenden Geschäftsjahres.

Referenzwert – 50 % ICE BofA - 5 year Euro Developed + 50 % ICE BofA - 5 year Euro Corporate

### ● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Da es sich nur um den ersten regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung handelt, ist kein Vergleich mit vorangegangenen Zeiträumen möglich.

### ● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Der Fonds hat sich nicht verpflichtet, nachhaltige Investitionen im Sinne der Offenlegungsverordnung zu tätigen. Als Ergebnis des Anlageverfahrens investierte der Fonds jedoch in nachhaltige Anlagen, die mit den vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen konform sind.

Der Anlageverwalter förderte unter anderem ökologische und soziale Merkmale und investierte in Emittenten, die eine gute Unternehmensführung praktizieren.

### ● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Diese Frage ist für diesen Fonds nicht zutreffend, wir bestätigen jedoch, dass wir nachhaltige Vermögenswerte darauf geprüft haben, ob sie erhebliche Beeinträchtigungen verursachen können. Dies erfolgte im Rahmen des Standard-Anlageprozesses von HSBC und unter Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen.

## *Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?*

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.

Diese Frage trifft nicht zu, der Anlageverwalter hat jedoch die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren befolgt, in der festgelegt ist, wie HSBC die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen identifiziert und darauf reagiert, und in welcher Form HSBC Nachhaltigkeitsrisiken berücksichtigt, die sich negativ auf Wertpapiere auswirken können, in die der Teilfonds investiert. HSBC identifizierte in Zusammenarbeit mit externen Datenanbietern, wie Sustainalytics, ISS, MSCI und Trucost, Unternehmen und Regierungen mit schlechter Bilanz beim Management von ESG-Risiken, und wo potenzielle wesentlichen Risiken identifiziert wurden, führte HSBC zusätzliche Due Diligence-Prüfungen durch. Durch Screening identifizierte Nachhaltigkeitsauswirkungen waren ein wichtiger Aspekt im Anlageentscheidungsprozess.

Der oben beschriebene Ansatz führte dazu, dass unter anderem folgende Faktoren geprüft wurden:

- Engagement der Emittenten für den Übergang zu CO<sub>2</sub>-armen Wirtschaften, zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern, Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus großen Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails; und
- Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit folgenden Bereichen: demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.

## *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:*

Diese Frage ist nicht anwendbar, da sich der Fonds nicht verpflichtet hat, nachhaltige Investitionen im Sinne der Offenlegungsverordnung zu tätigen. HSBC setzte sich jedoch für die Anwendung und Förderung globaler Standards ein und konzentrierte sich dabei auf die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren, die die zehn Grundsätze des UNGC umfasst. Diese Grundsätze stehen in Zusammenhang mit nicht finanziellen Risiken in den Bereichen Menschenrechte, Arbeit, Umweltschutz und Korruptionsbekämpfung. HSBC gehört darüber hinaus zu den Unterzeichnern der UN Principles for Responsible Investment. Diese bildeten den Rahmen für Ermittlung und Management von Nachhaltigkeitsrisiken beim Investmentansatz von HSBC. Von Emittenten, in die der Fonds investierte, wurde erwartet, dass sie die Anforderungen des UNGC und der damit verbundenen Standards erfüllen. Emittenten, die eindeutig gegen einen der zehn Grundsätze des UNGC verstoßen haben, wurden systematisch ausgeschlossen, es sei denn, sie haben eine Due-Diligence-Prüfung in Bezug auf ESG-Themen durchlaufen, um ihre Eignung für die Aufnahme in das Portfolio des Fonds zu bestimmen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen. Hierbei gelten spezifische von der Union definierte Kriterien.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*



### Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Teilfonds berücksichtigte die folgenden PAI, indem er sie als Nachhaltigkeitsindikatoren beobachtete:

- Verstöße gegen die UNGC- und OECD-Grundsätze; und
- Anteil der Investitionen mit Beteiligung an umstrittenen Waffen

Der Ansatz zur Berücksichtigung der PAI beinhaltete unter anderem, dass HSBC das Engagement der Unternehmen für den Übergang zu CO<sub>2</sub>-armen Wirtschaften, die zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern sowie die Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette prüfte, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails. Ebenfalls berücksichtigt wurde das Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit den Bereichen demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung. Ausgeschlossen waren auch Unternehmen, deren Geschäftsaktivitäten als umweltschädlich eingestuft wurden.

Das Screening führte dazu, dass HSBC nicht in bestimmte Unternehmen und Emittenten investierte.



### Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

| Größte Investitionen   | Sektor                         | % der Vermögenswerte | Land       |
|--|--------------------------------|----------------------|------------|
| Cellnex Finance Co. Sa 1,0 %<br>15.09.2027                               | Kommunikationsdienstleistungen | 2,37 %               | Spanien    |
| Banque Federative Du Credit Mutuel Societe Anonyme 2,625 %<br>31.03.2027 | Finanzen                       | 2,30 %               | Frankreich |
| Orano Sa 5,375 %<br>15.05.2027   | Versorger                      | 2,28 %               | Frankreich |
| Credit Agricole S.a. 2,625 %<br>17.03.2027                               | Finanzen                       | 2,22 %               | Frankreich |

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** Investitionen entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden: basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des Bezugszeitraums zum 31.03.2024

|   |                       |        |                                |
|---|-----------------------|--------|--------------------------------|
| Deutsche Bank Aktiengesellschaft<br>1,625% 20.01.2027                         | Finanzen              | 2,21 % | Deutschland                    |
| Valeo Se 5,375 % 28.05.2027   | Zyklische Konsumgüter | 2,21 % | Frankreich                     |
| Ford Motor Credit Company Llc<br>4,867 % 03.08.2027                           | Zyklische Konsumgüter | 2,07 % | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Mutuelle Assurance Commerçants Et Industriels France Sa 0,625 %<br>21.06.2027 | Finanzen              | 2,02 % | Frankreich                     |
| Mundys S.p.a. 1,875 %<br>13.07.2027   | Industriegüter        | 1,85 % | Italien                        |
| Autostrade Per L'italia S.p.a.<br>1,75 % 01.02.2027                           | Industriegüter        | 1,75 % | Italien                        |
| Societe Generale Sa 0,75 %<br>25.01.2027                                      | Finanzen              | 1,70 % | Frankreich                     |
| Berry Global, Inc. 1,5 %<br>15.01.2027  | Grundstoffe           | 1,57 % | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Intesa Sanpaolo S.p.a. 4,75 %<br>06.09.2027                                   | Finanzen              | 1,48 % | Italien                        |
| Teollisuuden Voima Oyj 2,625 %<br>31.03.2027                                  | Versorger             | 1,43 % | Finnland                       |
| Arval Service Lease Sa 4,75 %<br>22.05.2027                                   | Finanzen              | 1,41 % | Frankreich                     |

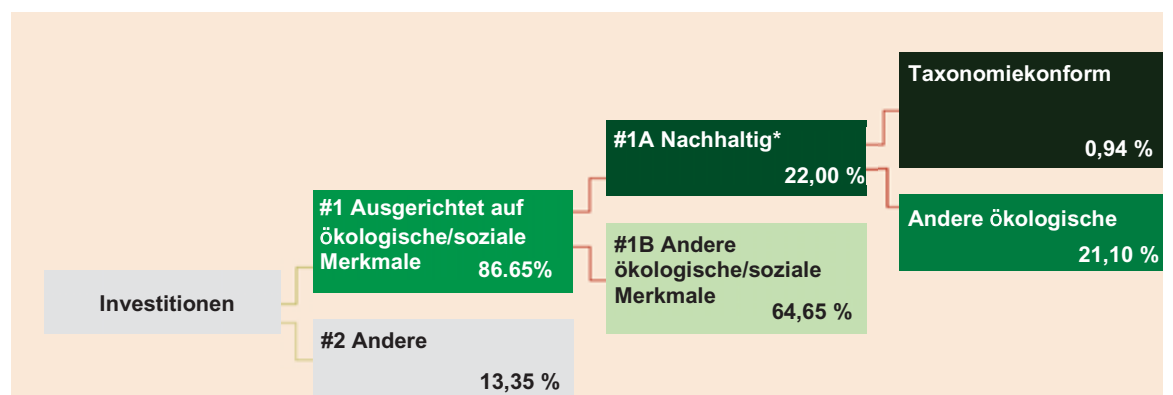
Barmittel und Derivate wurden nicht berücksichtigt



## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

22,00 % des Portfolios waren in nachhaltige Vermögenswerte investiert.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?



**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**#2 Andere Investitionen** umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

\* Ein Unternehmen oder Emittent, das bzw. der als nachhaltige Investition angesehen wird, kann sowohl zu einem sozialen als auch zu einem ökologischen Ziel beitragen, das an der EU-Taxonomie ausgerichtet sein kann oder nicht. Die Zahlen in der obigen Grafik berücksichtigen dies. Jedoch darf eine Gesellschaft oder ein Emittent unter dem Punkt der nachhaltigen Investitionen (#1A Nachhaltige Investitionen) nur einmal erfasst werden.

Die Prozentzahlen von taxonomiekonformen Investitionen und Andere ökologische Merkmale stimmen aufgrund der unterschiedlichen Berechnungsmethoden für nachhaltige Investitionen und taxonomiekonforme Investitionen nicht mit #1A Nachhaltige Investitionen überein.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

## In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

| Sektor / Teilsektor                          | % der Vermögenswerte |
|--|----------------------|
| Andere                                       | 32,34 %              |
| Finanzen                                     | 28,83 %              |
| Zyklische Konsumgüter                        | 11,03 %              |
| Immobilien                                   | 6,87 %               |
| Grundstoffe                                  | 4,13 %               |
| Industriegüter                               | 4,08 %               |
| Kommunikationsdienstleistungen               | 3,72 %               |
| Barmittel und Derivate                       | 3,05 %               |
| Versorger                                    | 1,72 %               |
| <i>Stromversorgungsbetriebe</i>              | 0,40 %               |
| <i>Erdgas</i>                                | 1,05 %               |
| <i>Multi-Versorger</i>                       | 0,05 %               |
| Informationstechnologie                      | 1,63 %               |
| Basiskonsumgüter                             | 1,30 %               |
| Energie                                      | 1,00 %               |
| <i>Integrierter Öl- und Gaskonzern</i>       | 0,07 %               |
| <i>Lagerung und Transport von Öl und Gas</i> | 0,93 %               |
| Gesundheitswesen                             | 0,30 %               |
| Summe  | 100,00 %             |

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



## Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

Der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen ist in den obigen Feldern zur Vermögensallokation ersichtlich.

### Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

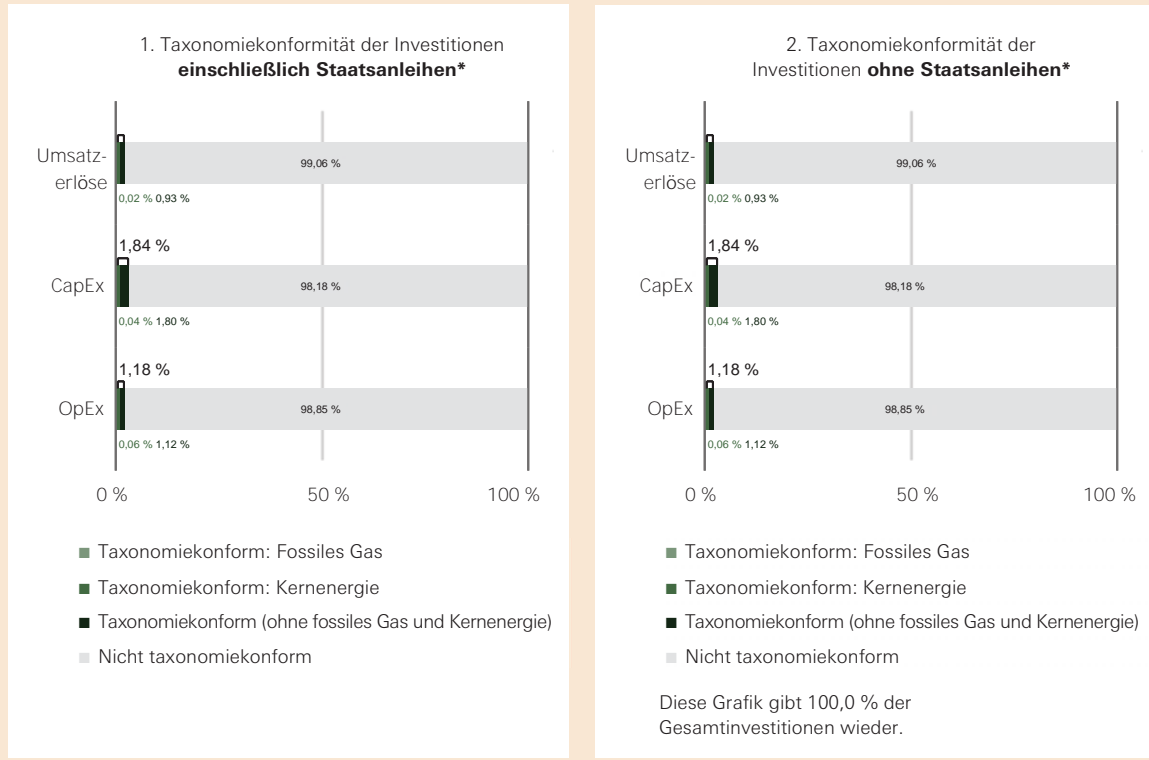
Ja:
  In fossiles Gas
  In Kernenergie

Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

**Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

**Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.**



\* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

**Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Im Referenzzeitraum betrug der Anteil der Investitionen des Fonds, die in Übergangstätigkeiten geflossen sind, 0,02 % und der Anteil der Investitionen, die in ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind, 0,15 %.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

**Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

| Indikator   | 2023-2024 | 2022-2023 |
|---|-----------|-----------|
| Umsatz – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                       | n. z.     | n. z.     |
| Umsatz – Taxonomiekonform: Kernenergie                        | 0,02 %    | n. z.     |
| Umsatz – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie) | 0,93 %    | n. z.     |
| Umsatz – Nicht taxonomiekonform                               | 99,06 %   | n. z.     |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                        | n. z.     | n. z.     |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                         | 0,04 %    | n. z.     |
| CAPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)  | 1,80 %    | n. z.     |
| CAPEX – Nicht taxonomiekonform                                | 98,18 %   | n. z.     |
| OPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                         | n. z.     | n. z.     |
| OPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                          | 0,06 %    | n. z.     |
| OPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)   | 1,12 %    | n. z.     |
| OPEX – Nicht taxonomiekonform                                 | 98,85 %   | n. z.     |

Da es sich erst um den zweiten Berichtszeitraum des Teilfonds handelt, ist ein Vergleich mit der Zeit davor nicht erforderlich.





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?**

Der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel war 21,10 %. Der Teilfonds hat sich nicht verpflichtet, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen.



### **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Teilfonds investierte nicht in sozial nachhaltige Anlagen.



### **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

#2 Andere Investitionen umfasst die Finanzinstrumente, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden. In manchen Fällen ist dies auf die Nichtverfügbarkeit von Daten und Unternehmensmaßnahmen zurückzuführen. Diese Positionen unterlagen nach wie vor dem vollständigen Ausschluss-Screening von HSBC und wurden im Hinblick auf verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Prinzipien des UNGC und der OECD geprüft.

Der Teilfonds hielt Barmittel / Barmitteläquivalente (der Prozentsatz der gehaltenen Barmittel ist in der obigen Tabelle der Sektoren/Teilsektoren unter der Überschrift „In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?“ ersichtlich) zum Zwecke des Liquiditätsmanagements sowie derivative Finanzinstrumente zum Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements. Barmittel / Barmitteläquivalente und derivative Finanzinstrumente verfügen aufgrund der Art dieser Instrumente über keinen ökologischen oder sozialen Mindestschutz.



### **Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?**

Im Laufe des Berichtszeitraums schloss der Anlageberater unter anderem verbotene Waffen, umstrittene Waffen, Unternehmen, die mehr als 10 % ihres Umsatzes aus Kraftwerkskohle und Energieerzeugung aus Kohle generieren, und Tabakherstellung aus und investierte in Unternehmen mit verantwortungsvollen Geschäftspraktiken gemäß den Prinzipien des UNGC. Der Teilfonds identifiziert und analysiert die ESG-Referenzen von Unternehmen als wesentlichen Bestandteil des Anlageentscheidungsprozesses. Die ESG-Referenzen stammen aus verschiedenen firmeneigenen Quellen von HSBC und von Drittanbietern, unterliegen kontinuierlichem Research und können sich im Laufe der Zeit ändern, wenn neue Referenzen identifiziert werden. Diese umfassen insbesondere: Ökologische und soziale Faktoren, insbesondere die physischen Risiken des Klimawandels und des Personalmanagements, die potenziell erhebliche Auswirkungen auf die finanzielle Performance und die Bewertung eines Wertpapieremittenten hatten. Im Rahmen des Anlageentscheidungsprozesses wurden ESG-Referenzen auf vielfältige Weise integriert:

- o Ausgenommen sind Unternehmen mit einem niedrigen ESG-Score und Unternehmen, die als nicht konform mit den Prinzipien des UNGC angesehen werden. Dieser Ausschluss liegt im Ermessen des Anlageberaters. Unternehmen mit einem sich verbessernden, aber immer noch niedrigen ESG-Score und Unternehmen, die erkennbar auf die Einhaltung der Prinzipien des UNGC zusteuern, kommen trotzdem als Investments in Frage.

- o Zusammenarbeit mit Unternehmen im Bereich Energiewende und ESG-Vorschriften



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Nicht zutreffend.

- **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?**

Nicht zutreffend.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifizierungssystem, 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.

**Name des Produkts:** HSBC GLOBAL INVESTMENT FUNDS - ASEAN EQUITY

**Unternehmenskennung (LEI-Code):** 213800GX2NCDIS6WSV60

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

| ●● <input type="checkbox"/> Ja   | ●○ <input checked="" type="checkbox"/> Nein   |
|--|---|
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel</b> getätigt: _ %                   | <input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit <b>ökologische/soziale Merkmale beworben</b> und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 14,15 % an nachhaltigen Investitionen |
| <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind       | <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind   |
| <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind  |
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel</b> getätigt: _ %                | <input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel  |
|  | <input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine <b>nachhaltigen Investitionen getätigt</b>   |



### Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Während des am 31. März 2024 endenden Geschäftsjahres (der Bezugszeitraum) hat der Teilfonds Folgendes beworben:

- Der Teilfonds berücksichtigte aktiv Investitionen mit geringer Kohlenstoffintensität im Vergleich zum Referenzwert
- Der Teilfonds prüfte und analysierte alle Unternehmen oder Emittenten im Hinblick auf ökologische Merkmale, insbesondere physische Risiken durch den Klimawandel und Personalmanagement. Für die zugrunde liegenden E-, S- und G-Säulen wurde ein Screening durchgeführt. „E“ und „S“ spiegeln die einzelnen Elemente der vom Teilfonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale wider, „G“ die

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Unternehmensführungspraktiken, die die Interessen von Minderheitsaktionären schützen und eine langfristige nachhaltige Wertschöpfung fördern.

Darüber hinaus berücksichtigte der Anlageberater:

1. verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Grundsätzen des Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC) und den Leitsätzen für multinationale Unternehmen der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für Unternehmen. Wurden potenzielle Verstöße gegen die Prinzipien des UNGC festgestellt, wurden die Emittenten einer eigenen Due-Diligence-Prüfung hinsichtlich ESG-Themen unterzogen, um festzustellen, ob sie für die Aufnahme in das Portfolio des Teilfonds geeignet sind, und sie auszuschließen, falls sie als ungeeignet erachtet wurden.
2. Er schloss Geschäftstätigkeiten aus, die als umweltschädlich galten, wie z. B. die Förderung von Kraftwerkskohle und die Kohleverstromung.
3. Er berücksichtigte aktiv ökologische und soziale Aspekte, indem er über unsere Engagement- und Stewardship-Teams Mitwirkung bei Emittenten umsetzte und sein Recht zur Stimmrechtsvertretung wahrnahm.
4. Er schloss nach entsprechender Analyse Anlagen in umstrittenen Waffen aus.

Die Berücksichtigung einzelner (in der nachstehenden Tabelle nummerierter) wichtigster nachteiliger Auswirkungen (PAI) drückt sich darin aus, dass der Teilfonds niedrigere Werte als der Referenzwert aufweist. Die bei der Berechnung der PAI-Werte verwendeten Daten stammen von externen Datenanbietern. Sie können auf Unternehmensangaben basieren oder von den Datenanbietern geschätzt werden, wo keine solchen Angaben vorliegen. Bitte beachten Sie, dass es nicht immer möglich ist, die Richtigkeit, Aktualität oder Vollständigkeit der von Drittanbietern bereitgestellten Daten zu garantieren.

Der Teilfonds wurde aktiv verwaltet und bildete keinen Referenzwert nach. Ein internes oder externes Ziel des Teilfonds bestand im Übertreffen des Referenzwerts, der jedoch nicht zum Erreichen der vom Teilfonds beworbenen ökologischen Merkmale diente.

Das Abschneiden der Nachhaltigkeitsindikatoren, die der Teilfonds zur Messung der Erreichung der von ihm beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet, ist in der folgenden Tabelle dargestellt.

Alle Unternehmen haben eine gute Unternehmensführung bewiesen, was sich am PAI-Score 10 unten ablesen lässt.

### **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

| Indikator  | Teilfonds | Referenzwert  |
|--|-----------|---------------|
| ESG-Score  | 6,47      | 6,41          |
| 1. THG-Emissionen – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente  | 420,31    | 86.293.746,11 |
| 2. CO <sub>2</sub> -Fußabdruck – Tonnen CO <sub>2</sub> pro Million Euro (EVIC)  | 13,92     | 145,99        |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente pro Million Euro Umsatz   | 79,58     | 341,34        |
| 4. Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind   | 0,00 %    | 8,54 %        |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 0,01 %    | 0,00 %        |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 0,00 %    | 0,00 %        |

Die Daten in diesem regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung beziehen sich auf den Stand vom 31. März 2024, basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des am 31. März 2024 endenden Geschäftsjahres.

Referenzwert – MSCI ASEAN

## ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

| Indikator  | Zeitraum zum  | Teilfonds | Referenzwert  |
|--|---------------|-----------|---------------|
| ESG-Score  | 31. März 2024 | 6,47      | 6,41          |
|  | 31. März 2023 | 0,00      | 0,00          |
| 1. THG-Emissionen – Tonnen CO <sub>2</sub> - Äquivalente   | 31. März 2024 | 420,31    | 86.293.746,11 |
|  | 31. März 2023 | 0,00      | 0,00          |
| 2. CO <sub>2</sub> -Fußabdruck – Tonnen CO <sub>2</sub> pro Million Euro EVIC  | 31. März 2024 | 13,92     | 145,99        |
|  | 31. März 2023 | 0,00      | 0,00          |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente pro Millionen Euro Umsatz                                       | 31. März 2024 | 79,58     | 341,34        |
|  | 31. März 2023 | 0,00      | 0,00          |
| 4. Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind   | 31. März 2024 | 0,00 %    | 8,54 %        |
|  | 31. März 2023 | 0,00 %    | 0,00 %        |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 31. März 2024 | 0,01 %    | 0,00 %        |
|  | 31. März 2023 | 0,00 %    | 0,00 %        |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische Waffen und biologische Waffen)  | 31. März 2024 | 0,00 %    | 0,00 %        |
|  | 31. März 2023 | 0,00 %    | 0,00 %        |

Da es sich erst um den zweiten regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung handelt, ist kein Vergleich mit vorangegangenen Zeiträumen möglich.

## Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Die vom Teilfonds getätigten nachhaltigen Investitionen trugen unter anderem zu folgenden ökologischen Zielen bei:

1. Reduzierung von Treibhausgasemissionen und Verringerung des CO<sub>2</sub>-Fußabdrucks;
2. Übergang zu oder die Nutzung von erneuerbarer Energie.

## Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltige Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Wir bestätigen, dass wir nachhaltige Vermögenswerte darauf geprüft haben, ob sie erhebliche Beeinträchtigungen verursachen können. Dies erfolgte im Rahmen des Standard-Anlageprozesses von HSBC Asset Management (HSBC) und unter Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen.

*Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?*

Der Anlageberater hat alle durch die Offenlegungsverordnung definierten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI) auf ihre Relevanz für den Teilfonds geprüft. Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren legt fest, wie HSBC die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen identifiziert und darauf reagiert, und in welcher Form HSBC Nachhaltigkeitsrisiken berücksichtigt, die sich negativ auf Wertpapiere auswirken können, in die der Teilfonds investiert. HSBC identifizierte in Zusammenarbeit mit externen Screening-Dienstleistern, wie Sustainalytics, ISS, MSCI und Trucost, Unternehmen und Regierungen mit schlechter Bilanz beim Management von ESG-Risiken, und wo solche wesentlichen

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.

Risiken identifiziert wurden, führte HSBC zusätzliche ESG-Due-Diligence-Prüfungen durch. Durch Screening identifizierte Nachhaltigkeitsauswirkungen einschließlich der PAI bildeten einen Schlüsselfaktor beim Anlageentscheidungsprozess.

Der oben beschriebene Ansatz führte dazu, dass unter anderem folgende Faktoren geprüft wurden:

- Engagement der Unternehmen für den Übergang zu CO2-armen Wirtschaften, zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern, Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus großen Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails; und
- Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit folgenden Bereichen: demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.

Die spezifischen PAI für diesen Teilfonds waren wie unten beschrieben.

Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren ist auf der Website [www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies](http://www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies) verfügbar.

*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:*

HSBC hat sich der Anwendung und Förderung globaler Standards verpflichtet. Die wichtigsten Schwerpunktbereiche der Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren entsprachen den zehn UNGC-Grundsätzen. Diese Grundsätze stehen in Zusammenhang mit nicht finanziellen Risiken in den Bereichen Menschenrechte, Arbeit, Umweltschutz und Korruptionsbekämpfung. HSBC gehört darüber hinaus zu den Unterzeichnern der UN Principles for Responsible Investment. Diese bildeten den Rahmen für Ermittlung und Management von Nachhaltigkeitsrisiken beim Investmentansatz von HSBC. Von Unternehmen, in die der Teilfonds investierte, wurde erwartet, dass sie die Anforderungen des UNGC und der damit verbundenen Standards erfüllen. Unternehmen, die belegbar gegen einen der zehn Grundsätze des UNGC verstießen, wurden systematisch ausgeschlossen. Der Teilfonds führte verstärkte Due-Diligence-Prüfungen bei Unternehmen durch, die als nicht konform mit den Prinzipien des UNGC angesehen wurden oder die nach den unternehmenseigenen ESG Ratings von HSBC als risikoreich angesehen wurden. Darüber hinaus wurden die Unternehmen nach internationalen Standards wie den OECD-Leitsätzen bewertet.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen. Hierbei gelten spezifische von der Union definierte Kriterien.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*



## Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Teilfonds berücksichtigte die folgenden PAI, indem er sie als Nachhaltigkeitsindikatoren beobachtete:

- Treibhausgasemissionen (Scope 1 und Scope 2)
- CO<sub>2</sub>-Fußabdruck (Scope 1 und Scope 2)
- Treibhausgasintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1 und Scope 2)
- Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
- Verstöße gegen die UNGC- und OECD-Grundsätze; und
- Anteil der Investitionen mit Beteiligung an umstrittenen Waffen

Der Ansatz zur Berücksichtigung der PAI beinhaltete unter anderem, dass HSBC das Engagement der Unternehmen für den Übergang zu CO<sub>2</sub>-armen Wirtschaften, die zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern sowie die Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette prüfte, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails. Ebenfalls berücksichtigt wurde das Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit den Bereichen demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung. Ausgeschlossen waren auch Unternehmen, deren Geschäftsaktivitäten als umweltschädlich eingestuft wurden.

Das Screening führte dazu, dass HSBC nicht in bestimmte Unternehmen und Emittenten investierte.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** Investitionen entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden: basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des Bezugszeitraums zum 31.03.2024



## Welche sind die Hauptinvestitionen diesem Finanzprodukts?

| Größte Investitionen                           | Sektor   | % der Vermögenswerte | Land       |
|--|----------|----------------------|------------|
| DBS Group Holdings Ltd                         | Finanzen | 9,80 %               | Singapur   |
| Oversea – Chinese Banking Corporation Limited  | Finanzen | 8,04 %               | Singapur   |
| PT Bank Rakyat Indonesia (Persero) Tbk Class B | Finanzen | 6,89 %               | Indonesien |

|   |                                |        |             |
|---|--------------------------------|--------|-------------|
| PT Bank Mandiri (Persero) Tbk             | Finanzen                       | 5,13 % | Indonesien  |
| PT Telkom Indonesia (Persero) Tbk Class B | Kommunikationsdienstleistungen | 4,48 % | Indonesien  |
| Sea Limited Sponsored ADR Class A         | Kommunikationsdienstleistungen | 4,29 % | Singapur    |
| CIMB Group Holdings Bhd                   | Finanzen                       | 4,25 % | Malaysia    |
| United Overseas Bank Limited              | Finanzen                       | 3,78 % | Singapur    |
| BDO Unibank, Inc.                         | Finanzen                       | 3,66 % | Philippinen |

Barmittel und Derivate wurden nicht berücksichtigt

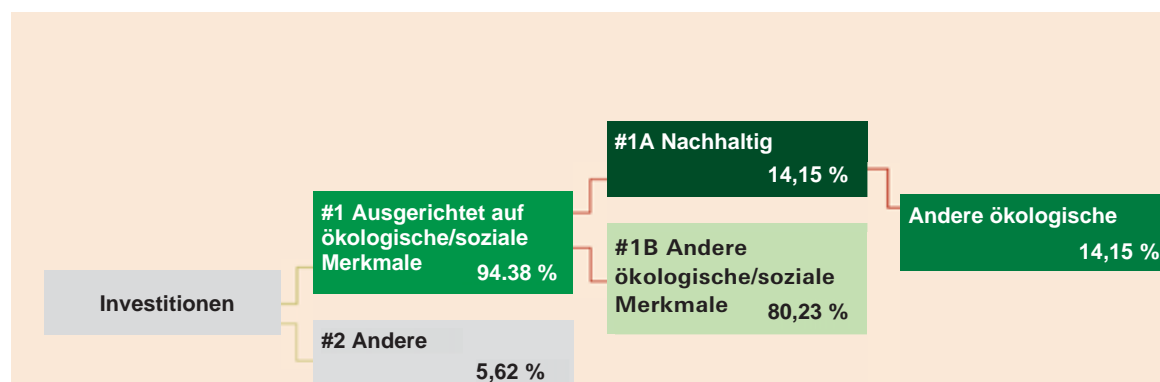


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

14,15 % des Portfolios waren in nachhaltige Vermögenswerte investiert.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?



**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**#2 Andere Investitionen** umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

### In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

| Sektor / Teilsektor            | % der Vermögenswerte |
|--------------------------------|----------------------|
| Finanzen                       | 44,28 %              |
| Kommunikationsdienstleistungen | 15,54 %              |
| Industriegüter                 | 9,54 %               |
| Immobilien                     | 7,97 %               |
| Zyklische Konsumgüter          | 6,46 %               |
| Gesundheitswesen               | 5,52 %               |
| Barmittel und Derivate         | 2,99 %               |
| Basiskonsumgüter               | 2,48 %               |
| Informationstechnologie        | 2,20 %               |
| Andere                         | 1,56 %               |
| Grundstoffe                    | 1,43 %               |
| Staatsanleihen                 | 0,03 %               |
| Summe                          | 100,00 %             |





## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen lag bei 0 %. Der Teilfonds hat sich nicht verpflichtet, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen.

### Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?

Ja:

In fossiles Gas       In Kernenergie

Nein

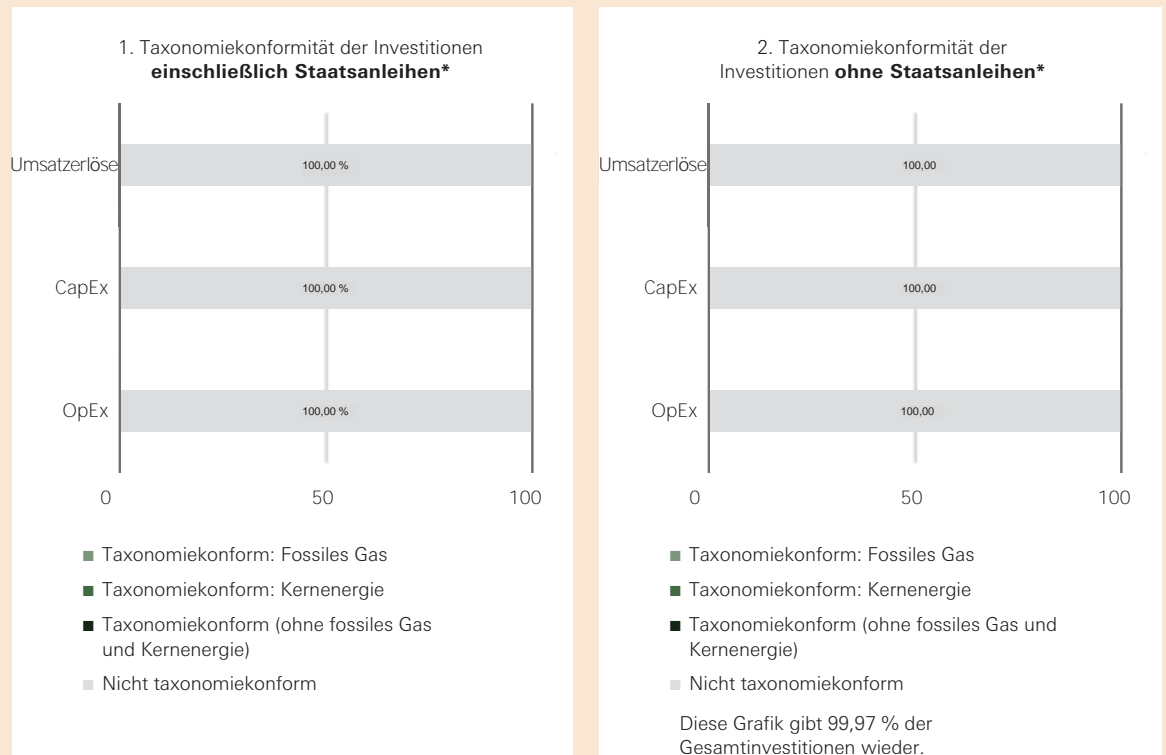
<sup>1</sup> Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Mit Blick auf die EU-Taxonomie-konformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Taxonomie-konforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

**Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.**



\* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

### Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Im Referenzzeitraum betrug der Anteil der Investitionen des Fonds, die in Übergangstätigkeiten geflossen sind, 0,00 % und der Anteil der Investitionen, die in ermöglichende Tätigkeiten geflossen ist, 0,00 %.


**Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

| Indikator   | 2023-2024 | 2022-2023 |
|---|-----------|-----------|
| Umsatz – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                       | n. z.     | n. z.     |
| Umsatz – Taxonomiekonform: Kernenergie                        | n. z.     | n. z.     |
| Umsatz – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie) | n. z.     | n. z.     |
| Umsatz – Nicht taxonomiekonform                               | 100,00 %  | n. z.     |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                        | n. z.     | n. z.     |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                         | n. z.     | n. z.     |
| CAPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)  | n. z.     | n. z.     |
| CAPEX – Nicht taxonomiekonform                                | 100,00 %  | n. z.     |
| OPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                         | n. z.     | n. z.     |
| OPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                          | n. z.     | n. z.     |
| OPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)   | n. z.     | n. z.     |
| OPEX – Nicht taxonomiekonform                                 | 100,00 %  | n. z.     |

Da es sich erst um den zweiten Berichtszeitraum des Teilfonds handelt, ist ein Vergleich mit der Zeit davor nicht erforderlich.

 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?**

Der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel war 14,15 %. Der Teilfonds hat sich nicht verpflichtet, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen.

 **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Teilfonds investierte nicht in sozial nachhaltige Anlagen.

 **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

#2 Andere Investitionen umfasst die Finanzinstrumente, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden. In manchen Fällen ist dies auf die Nichtverfügbarkeit von Daten und Unternehmensmaßnahmen zurückzuführen. Diese Positionen unterlagen nach wie vor dem vollständigen Ausschluss-Screening von HSBC und wurden im Hinblick auf verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Prinzipien des UNGC und der OECD geprüft.

Der Teilfonds hielt Barmittel / Barmitteläquivalente (der Prozentsatz der gehaltenen Barmittel ist in der obigen Tabelle der Sektoren/Teilsektoren unter der Überschrift „In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?“ ersichtlich) zum Zwecke des Liquiditätsmanagements sowie derivative Finanzinstrumente zum Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements. Barmittel / Barmitteläquivalente und derivative Finanzinstrumente verfügen aufgrund der Art dieser Instrumente über keinen ökologischen oder sozialen Mindestschutz.



**Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?**

Im Laufe des Berichtszeitraums schloss der Anlageberater unter anderem verbotene Waffen, umstrittene Waffen, Unternehmen, die mehr als 10 % ihres Umsatzes aus Kraftwerkskohle und Energieerzeugung aus Kohle generieren, und Tabakherstellung aus und investierte in Unternehmen mit verantwortungsvollen Geschäftspraktiken gemäß den Prinzipien des UNGC.

Nach der Identifizierung des zulässigen Anlageuniversums konstruierte der Anlageberater ein Portfolio, dessen CO<sub>2</sub>-Intensität (berechnet als gewichteter Durchschnitt der CO<sub>2</sub>-Intensitäten der Anlagen des Teilfonds) niedriger ist als der gewichtete Durchschnitt der Bestandteile des Referenzwerts. Dies führte zu einem PAI-Score, der unter dem Referenzwert lag. Der Teilfonds bewertete auch ESG-Scores mit dem Ergebnis, dass der ESG-Score während des gesamten Berichtszeitraums über dem des Referenzwerts lag.

Darüber hinaus wurden alle Positionen auf Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der OECD untersucht, um Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung innerhalb des Portfolios sicherzustellen.



### **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

#### **● *Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?***

Nicht zutreffend.

#### **● *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?***

Nicht zutreffend.

#### **● *Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?***

Nicht zutreffend.

#### **● *Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?***

Nicht zutreffend.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Name des Produkts: HSBC GLOBAL INVESTMENT FUNDS - ASIA EX JAPAN EQUITY

Unternehmenskennung (LEI-Code): 21380086TMCIPDOJ1191

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen 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

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: \_ %**

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: \_ %**

Nein

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 37,21 % an nachhaltigen Investitionen

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben**, aber keine **nachhaltigen Investitionen getätigt**



### Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Während des am 31. März 2024 endenden Geschäftsjahres (der Bezugszeitraum) hat der Teilfonds Folgendes beworben:

1. Es wurde auf das Erreichen eines ESG-Score des Teilfonds hingearbeitet, der über dem vom Teilfonds ausgewählten Referenzindex liegt (ein höherer Score als der

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Referenzwert bedeutet bessere ESG-Referenzen).

2. Der Teilfonds prüfte und analysierte alle Unternehmen oder Emittenten im Hinblick auf ökologische Merkmale, insbesondere physische Risiken durch den Klimawandel und Personalmanagement. Für die zugrunde liegenden E-, S- und G-Säulen wurden ein Screening sowie ein Vergleich mit dem für den Teilfonds definierten Referenzwert durchgeführt. „E“ und „S“ spiegeln die einzelnen Elemente der vom Teilfonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale wider, „G“ die Unternehmensführungspraktiken, die die Interessen von Minderheitsaktionären schützen und eine langfristige nachhaltige Wertschöpfung fördern.
3. Der Teilfonds berücksichtigte verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Grundsätzen des Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC) und den Leitsätzen für multinationale Unternehmen der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für Unternehmen. Wurden potenzielle Verstöße gegen die Prinzipien des UNGC festgestellt, wurden die Emittenten einer eigenen Due-Diligence-Prüfung hinsichtlich ESG-Themen unterzogen, um festzustellen, ob sie für die Aufnahme in das Portfolio des Teilfonds geeignet sind, und sie auszuschließen, falls sie als ungeeignet erachtet wurden.
4. Der Teilfonds schloss Geschäftstätigkeiten aus, die als umweltschädlich gelten, wie z. B. die Förderung von Kraftwerkskohle und die Kohleverstromung.
5. Der Teilfonds berücksichtigte aktiv ökologische und soziale Aspekte, indem er über unsere Engagement- und Stewardship-Teams Mitwirkung bei Emittenten umsetzte und sein Recht zur Stimmrechtsvertretung wahrnahm.
6. Der Teilfonds schloss Anlagen in umstrittenen Waffen aus.

Die auf ESG und Nachhaltigkeitsindikatoren bezogenen Scores werden anhand der proprietären Methodik von HSBC Asset Management und externer ESG-Datenanbieter berechnet. Die Berücksichtigung einzelner (in der nachstehenden Tabelle nummerierter) wichtigster nachteiliger Auswirkungen (PAI) drückt sich darin aus, dass der Teilfonds niedrigere Werte als der Referenzwert aufweist. Die bei der Berechnung der PAI-Werte verwendeten Daten stammen von externen Datenanbietern. Sie können auf Unternehmensangaben basieren oder von den Datenanbietern geschätzt werden wo keine solchen Angaben vorliegen. Bitte beachten Sie, dass es nicht immer möglich ist, die Richtigkeit, Aktualität oder Vollständigkeit der von Drittanbietern bereitgestellten Daten zu garantieren.

Der Teilfonds wurde aktiv verwaltet und bildete keinen Referenzwert nach. Ein internes oder externes Ziel des Teilfonds bestand im Übertreffen des Referenzwerts, der jedoch nicht zum Erreichen der vom Teilfonds beworbenen ökologischen Merkmale diente.

Das Abschneiden der Nachhaltigkeitsindikatoren, die der Teilfonds zur Messung der Erreichung der von ihm beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet, ist in der folgenden Tabelle dargestellt.

Alle Unternehmen/Emittenten haben eine gute Unternehmensführung bewiesen, was sich am PAI-Score 10 unten ablesen lässt.

### **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

| Indikator  | Teilfonds | Referenzwert   |
|--|-----------|----------------|
| 1. THG-Emissionen – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente  | 11.788,56 | 871.936.834,19 |
| 2. CO <sub>2</sub> -Fußabdruck – Tonnen CO <sub>2</sub> pro Million Euro (EVIC)  | 34,97     | 159,15         |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente pro Million Euro Umsatz | 112,10    | 327,20         |

|  |        |        |
|--|--------|--------|
| 4. Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind   | 4,85 % | 5,46 % |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 7,55 % | 7,00 % |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 0,00 % | 0,00 % |

Die Daten in diesem regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung beziehen sich auf den Stand vom 31. März 2024, basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des am 31. März 2024 endenden Geschäftsjahres.

Referenzwert – MSCI All Country Asia Ex-Japan

**... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

| Indikator  | Zeitraum zum  | Teilfonds | Referenzwert   |
|--|---------------|-----------|----------------|
| 1. THG-Emissionen – Tonnen CO2-Äquivalente   | 31. März 2024 | 11.788,56 | 871.936.834,19 |
|  | 31. März 2023 | 14.123,85 | 997.922.443,60 |
| 2. CO2-Fußabdruck – Tonnen CO2 pro Million Euro (EVIC)   | 31. März 2024 | 34,97     | 159,15         |
|  | 31. März 2023 | 34,77     | 176,76         |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO2-Äquivalente pro Million Euro Umsatz  | 31. März 2024 | 112,10    | 327,20         |
|  | 31. März 2023 | 146,76    | 338,51         |
| 4. Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind   | 31. März 2024 | 4,85 %    | 5,46 %         |
|  | 31. März 2023 | 4,97 %    | 5,16 %         |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 31. März 2024 | 7,55 %    | 7,00 %         |
|  | 31. März 2023 | 9,50 %    | 7,76 %         |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 31. März 2024 | 0,00 %    | 0,00 %         |
|  | 31. März 2023 | 0,00 %    | 0,02 %         |

Da es sich erst um den zweiten regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung handelt, ist kein Vergleich mit vorangegangenen Zeiträumen möglich.

**Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die vom Teilfonds getätigten nachhaltigen Investitionen trugen unter anderem zu folgenden ökologischen Zielen bei:

1. Reduzierung von Treibhausgasemissionen und Verringerung des CO2-Fußabdrucks;
2. Übergang zu oder die Nutzung von erneuerbarer Energie.

Der Teilfonds bezog die Identifizierung und Analyse der ESG-Referenzen eines Unternehmens als integralen Bestandteil in den Anlageentscheidungsprozess ein, um die Bewertung von Risiken und potenziellen Renditen zu unterstützen.

**Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Wir bestätigen, dass wir nachhaltige Vermögenswerte darauf geprüft haben, ob sie erhebliche Beeinträchtigungen verursachen können. Dies erfolgte im Rahmen

des Standard-Anlageprozesses von HSBC Asset Management (HSBC) und unter Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen.

*Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?*

Der Anlageberater hat alle durch die Offenlegungsverordnung definierten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI) auf ihre Relevanz für den Teilfonds geprüft. Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren legt fest, wie HSBC die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen identifiziert und darauf reagiert, und in welcher Form HSBC Nachhaltigkeitsrisiken berücksichtigt, die sich negativ auf Wertpapiere auswirken können, in die der Teilfonds investiert. HSBC identifizierte in Zusammenarbeit mit externen Screening-Dienstleistern, wie Sustainalytics, ISS, MSCI und Trucost, Unternehmen und Regierungen mit schlechter Bilanz beim Management von ESG-Risiken, und wo solche wesentlichen Risiken identifiziert wurden, führte HSBC zusätzliche ESG-Due-Diligence-Prüfungen durch. Durch Screening identifizierte Nachhaltigkeitsauswirkungen einschließlich der PAI bildeten einen Schlüsselfaktor beim Anlageentscheidungsprozess.

Der oben beschriebene Ansatz führte dazu, dass unter anderem folgende Faktoren geprüft wurden:

- Engagement der Unternehmen für den Übergang zu CO<sub>2</sub>-armen Wirtschaften, zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern, Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus großen Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails; und
- Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit folgenden Bereichen: demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.

Die spezifischen PAI für diesen Teilfonds waren wie unten beschrieben.

Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren ist auf der Website [www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies](http://www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies) verfügbar.

*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:*

HSBC hat sich der Anwendung und Förderung globaler Standards verpflichtet. Die wichtigsten Schwerpunktbereiche der Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren entsprachen den zehn UNGC-Grundsätzen. Diese Grundsätze stehen in Zusammenhang mit nicht finanziellen Risiken in den Bereichen Menschenrechte, Arbeit, Umweltschutz und Korruptionsbekämpfung. HSBC gehört darüber hinaus zu den

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.

Unterzeichnern der UN Principles for Responsible Investment. Diese bildeten den Rahmen für Ermittlung und Management von Nachhaltigkeitsrisiken beim Investmentansatz von HSBC.

Von Unternehmen, in die der Teilfonds investierte, wurde erwartet, dass sie die Anforderungen des UNGC und der damit verbundenen Standards erfüllen. Unternehmen, die belegbar gegen einen der zehn Grundsätze des UNGC verstießen, wurden systematisch ausgeschlossen. Der Teilfonds führte verstärkte Due-Diligence-Prüfungen bei Unternehmen durch, die als nicht konform mit den Prinzipien des UNGC angesehen wurden oder die nach den unternehmenseigenen ESG Ratings von HSBC als risikoreich angesehen wurden. Darüber hinaus wurden die Unternehmen nach internationalen Standards wie den OECD-Leitsätzen bewertet.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen. Hierbei gelten spezifische von der Union definierte Kriterien.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*



### **Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Der Teilfonds berücksichtigte die folgenden PAI, indem er sie als Nachhaltigkeitsindikatoren beobachtete:

- Treibhausgasemissionen (Scope 1 und Scope 2)
- CO<sub>2</sub>-Fußabdruck (Scope 1 und Scope 2)
- Treibhausgasintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1 und Scope 2)
- Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
- Verstöße gegen die UNGC- und OECD-Grundsätze; und
- Anteil der Investitionen mit Beteiligung an umstrittenen Waffen

Der Ansatz zur Berücksichtigung der PAI beinhaltete unter anderem, dass HSBC das Engagement der Unternehmen für den Übergang zu CO<sub>2</sub>-armen Wirtschaften, die zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern sowie die Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette prüfte, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails. Ebenfalls berücksichtigt wurde das Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit den Bereichen demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien



(einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung. Ausgeschlossen waren auch Unternehmen, deren Geschäftsaktivitäten als umweltschädlich eingestuft wurden.

Das Screening führte dazu, dass HSBC nicht in bestimmte Unternehmen und Emittenten investierte.



## Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der Investitionen** entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden: basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des Bezugszeitraums zum 31.03.2024

| Größte Investitionen                           | Sektor                         | % der Vermögenswerte Land |
|--|--------------------------------|---------------------------|
| Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd.   | Informationstechnologie        | 9,49 % Taiwan             |
| Samsung Electronics Co., Ltd.                  | Informationstechnologie        | 6,83 % Korea              |
| Tencent Holdings Ltd.                          | Kommunikationsdienstleistungen | 6,04 % China              |
| Reliance Industries Limited                    | Energie                        | 3,75 % Indien             |
| Alibaba Group Holding Limited                  | Zyklische Konsumgüter          | 3,48 % China              |
| SK hynix Inc.                                  | Informationstechnologie        | 3,33 % Korea              |
| AIA Group Limited                              | Finanzen                       | 3,25 % Hongkong           |
| PT Bank Rakyat Indonesia (Persero) Tbk Class B | Finanzen                       | 3,20 % Indonesien         |
| Shriram Finance Limited                        | Finanzen                       | 2,70 % Indien             |
| DLF Limited                                    | Immobilien                     | 2,50 % Indien             |
| Bharti Airtel Limited                          | Kommunikationsdienstleistungen | 2,45 % Indien             |
| MediaTek Inc                                   | Informationstechnologie        | 2,45 % Taiwan             |
| ICICI Bank Limited                             | Finanzen                       | 2,41 % Indien             |

Barmittel und Derivate wurden nicht berücksichtigt

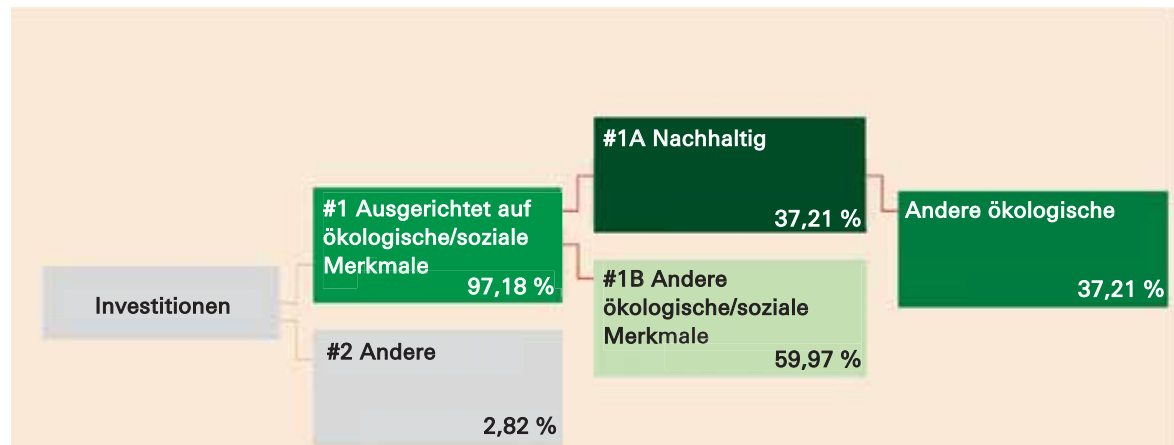


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

37,21 % des Portfolios waren in nachhaltige Vermögenswerte investiert.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?



**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**#2 Andere Investitionen** umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

### In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

| Sektor / Teilsektor                              | % der Vermögenswerte |
|--|----------------------|
| Informationstechnologie                          | 31,86 %              |
| Finanzen   | 20,67 %              |
| Zyklische Konsumgüter                            | 13,65 %              |
| Kommunikationsdienstleistungen                   | 10,99 %              |
| Industriegüter                                   | 4,26 %               |
| Energie  | 4,15 %               |
| <i>Exploration und Produktion von Öl und Gas</i> | 0,47 %               |
| <i>Raffination und Vertrieb von Öl und Gas</i>   | 3,68 %               |
| Gesundheitswesen                                 | 3,25 %               |
| Basiskonsumgüter                                 | 2,94 %               |
| Versorger  | 2,61 %               |
| <i>Stromversorgungsbetriebe</i>                  | 0,43 %               |
| <i>Erdgas</i>                                    | 1,49 %               |
| Immobilien                                       | 2,50 %               |
| Barmittel und Derivate                           | 1,91 %               |
| Andere   | 0,82 %               |
| Grundstoffe                                      | 0,40 %               |
| Staatsanleihen                                   | 0,01 %               |
| Summe  | 100,00 %             |

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO2-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



## Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

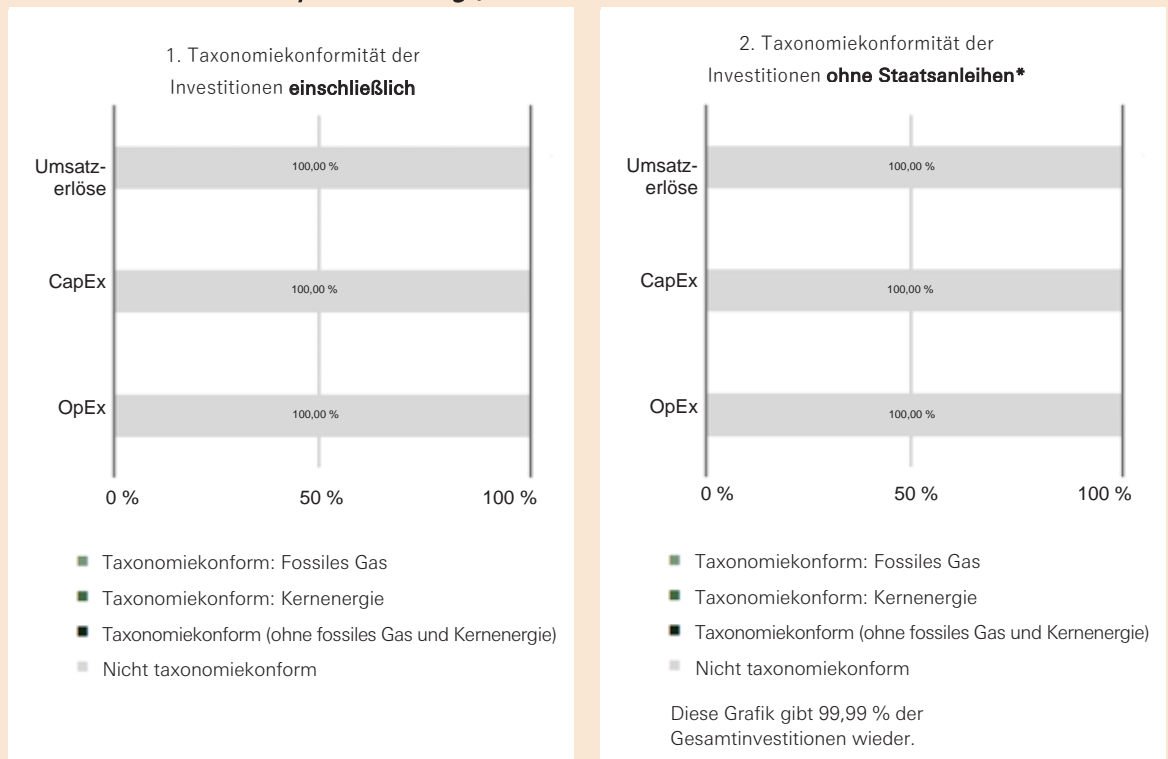
Der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen ist in den obigen Feldern zur Vermögensallokation ersichtlich.

### Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

Ja:
   
 In fossiles Gas     In Kernenergie
   
 Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

*Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.*



*\* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.*

### Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Im Referenzzeitraum betrug der Anteil der Investitionen des Fonds, die in

**Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.


**Ermöglichte Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten geflossen sind, 0,00 % und der Anteil der Investitionen, die in ermöglichende Tätigkeiten geflossen ist, 0,00 %.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**


| Indikator   | 2023-2024 | 2022-2023 |
|---|-----------|-----------|
| Umsatz – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                       | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform: Kernenergie                        | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie) | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Nicht taxonomiekonform                               | 100,00 %  | 100,00 %  |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                        | n. z.     | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                         | n. z.     | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)  | n. z.     | 0,00 %    |
| CAPEX – Nicht taxonomiekonform                                | 100,00 %  | 100,00 %  |
| OPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                         | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                          | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)   | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Nicht taxonomiekonform                                 | 100,00 %  | 100,00 %  |

Da es sich erst um den zweiten Berichtszeitraum des Teilfonds handelt, ist ein Vergleich mit der Zeit davor nicht erforderlich.


 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?**

Der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel war 37,21 %. Der Teilfonds hat sich nicht verpflichtet, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen.

 **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Teilfonds investierte nicht in sozial nachhaltige Anlagen.

 **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

#2 Andere Investitionen umfasst die Finanzinstrumente, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden. In manchen Fällen ist dies auf die Nichtverfügbarkeit von Daten und Unternehmensmaßnahmen zurückzuführen. Diese Positionen unterlagen nach wie vor dem vollständigen Ausschluss-Screening von HSBC und wurden im Hinblick auf verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Prinzipien des UNGC und der OECD geprüft.

Der Teilfonds hielt Barmittel / Barmitteläquivalente (der Prozentsatz der gehaltenen Barmittel ist in der obigen Tabelle der Sektoren/Teilsektoren unter der Überschrift „In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?“ ersichtlich) zum Zwecke des Liquiditätsmanagements sowie derivative Finanzinstrumente zum Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements. Barmittel / Barmitteläquivalente und derivative Finanzinstrumente verfügen aufgrund der Art dieser Instrumente über keinen ökologischen oder sozialen Mindestschutz.



## Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Im Laufe des Berichtszeitraums schloss der Anlageberater unter anderem verbotene Waffen, umstrittene Waffen, Unternehmen, die mehr als 10 % ihres Umsatzes aus Kraftwerkskohle und Energieerzeugung aus Kohle generieren, und Tabakherstellung aus und investierte in Unternehmen mit verantwortungsvollen Geschäftspraktiken gemäß den Prinzipien des UNGC.

Alle Positionen im Portfolio wurden hinsichtlich ihrer individuellen Kohlenstoffintensität untersucht, was zu einer Kohlenstoffintensität des Portfolios führte, die besser als die des Referenzwerts war. Der Teilfonds bewertete auch ESG-Scores mit dem Ergebnis, dass der ESG-Score während des gesamten Berichtszeitraums über dem des Referenzwerts lag.

Wurden außerdem wesentliche ESG-Risiken oder ein potenzieller Verstoß gegen einen oder mehrere der zehn Prinzipien des UNGC festgestellt, führte der Portfoliomanager/Analyst eine intensive Due-Diligence-Prüfung in Bezug auf ESG-Themen durch und holte die Genehmigung des Investitionsausschusses ein, bevor Investitionen getätigt werden konnten



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend.

- *Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?*

Nicht zutreffend.

- *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?*

Nicht zutreffend.

- *Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?*

Nicht zutreffend.

- *Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?*

Nicht zutreffend.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen 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.

**Name des Produkts:** HSBC GLOBAL INVESTMENT FUNDS - ASIA EX JAPAN EQUITY SMALLER COMPANIES

**Unternehmenskennung (LEI-Code):** 21380036FEZ4XDRMY876

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

**Ja**

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: \_ %

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: \_ %

**Nein**

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 10,55 % an nachhaltigen Investitionen

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine **nachhaltigen Investitionen getätigt**



### Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Während des am 31. März 2024 endenden Geschäftsjahres (der Bezugszeitraum) hat der Teilfonds Folgendes beworben:

1. Der Teilfonds berücksichtigte aktiv Investitionen mit geringer Kohlenstoffintensität im Vergleich zum Referenzwert.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

2. Der Teilfonds prüfte und analysierte alle Unternehmen oder Emittenten im Hinblick auf ökologische Merkmale, insbesondere physische Risiken durch den Klimawandel und Personalmanagement. Für die zugrunde liegenden E-, S- und G-Säulen wurde ein Screening durchgeführt. „E“ und „S“ spiegeln die einzelnen Elemente der vom Teilfonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale wider, „G“ die Unternehmensführungspraktiken, die die Interessen von Minderheitsaktionären schützen und eine langfristige nachhaltige Wertschöpfung fördern.

3. Der Teilfonds berücksichtigte verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Grundsätzen des Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC) und den Leitsätzen für multinationale Unternehmen der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für Unternehmen. Wurden potenzielle Verstöße gegen die Prinzipien des UNGC festgestellt, wurden die Emittenten einer eigenen Due-Diligence-Prüfung hinsichtlich ESG-Themen unterzogen, um festzustellen, ob sie für die Aufnahme in das Portfolio des Teilfonds geeignet sind, und sie auszuschließen, falls sie als ungeeignet erachtet wurden.

4. Der Teilfonds schloss Geschäftstätigkeiten aus, die als umweltschädlich gelten, wie z. B. die Förderung von Kraftwerkskohle und die Kohleverstromung.

5. Der Teilfonds berücksichtigte aktiv ökologische und soziale Aspekte, indem er über unsere Engagement- und Stewardship-Teams Mitwirkung bei Emittenten umsetzte und sein Recht zur Stimmrechtsvertretung wahrnahm.

6. Der Teilfonds schloss nach entsprechender Analyse Anlagen in umstrittenen Waffen aus.

Die Berücksichtigung einzelner (in der nachstehenden Tabelle nummerierter) wichtigster nachteiliger Auswirkungen (PAI) drückt sich darin aus, dass der Teilfonds niedrigere Werte als der Referenzwert aufweist. Die bei der Berechnung der PAI-Werte verwendeten Daten stammen von externen Datenanbietern. Sie können auf Unternehmensangaben basieren oder von den Datenanbietern geschätzt werden, wo keine solchen Angaben vorliegen. Bitte beachten Sie, dass es nicht immer möglich ist, die Richtigkeit, Aktualität oder Vollständigkeit der von Drittanbietern bereitgestellten Daten zu garantieren.

Der Teilfonds wurde aktiv verwaltet und bildete keinen Referenzwert nach. Ein internes oder externes Ziel des Teilfonds bestand im Übertreffen des Referenzwerts, der jedoch nicht zum Erreichen der vom Teilfonds beworbenen ökologischen Merkmale diente.

Das Abschneiden der Nachhaltigkeitsindikatoren, die der Teilfonds zur Messung der Erreichung der von ihm beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet, ist in der folgenden Tabelle dargestellt.

Alle Unternehmen haben eine gute Unternehmensführung bewiesen, was sich am PAI-Score 10 unten ablesen lässt.

### ● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

| <b>Indikator</b>   | <b>Teilfonds</b> | <b>Referenzwert</b> |
|--|------------------|---------------------|
| 1. THG-Emissionen – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente  | 127.656,80       | 191.191.247,10      |
| 2. CO <sub>2</sub> -Fußabdruck – Tonnen CO <sub>2</sub> pro Million Euro (EVIC)  | 300,66           | 212,86              |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente pro Million Euro Umsatz   | 238,22           | 425,29              |
| 4. Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind   | 1,85 %           | 3,18 %              |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 0,17 %           | 0,54 %              |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 0,00 %           | 0,32 %              |

Die Daten in diesem regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung beziehen sich auf den Stand vom 31. März 2024, basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des am 31. März 2024 endenden Geschäftsjahres.

Referenzwert – MSCI AC Asia ex JP Small Cap

### ● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

| Indikator  | Zeitraum zum  | Teilfonds  | Referenzwert   |
|--|---------------|------------|----------------|
| 1. THG-Emissionen – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente  | 31. März 2024 | 127.656,80 | 191.191.247,10 |
|  | 31. März 2023 | 38.996,65  | 172.281.034,56 |
| 2. CO <sub>2</sub> -Fußabdruck – Tonnen CO <sub>2</sub> pro Million Euro (EVIC)  | 31. März 2024 | 300,66     | 212,86         |
|  | 31. März 2023 | 86,46      | 184,15         |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente pro Million Euro Umsatz   | 31. März 2024 | 238,22     | 425,29         |
|  | 31. März 2023 | 224,88     | 461,77         |
| 4. Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind   | 31. März 2024 | 1,85 %     | 3,18 %         |
|  | 31. März 2023 | 3,39 %     | 3,53 %         |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 31. März 2024 | 0,17 %     | 0,54 %         |
|  | 31. März 2023 | 0,00 %     | 0,36 %         |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 31. März 2024 | 0,00 %     | 0,32 %         |
|  | 31. März 2023 | 0,00 %     | 0,14 %         |

Da es sich erst um den zweiten regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung handelt, ist kein Vergleich mit vorangegangenen Zeiträumen möglich.

### ● Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Die vom Teilfonds getätigten nachhaltigen Investitionen trugen unter anderem zu folgenden ökologischen Zielen bei:

1. Reduzierung von Treibhausgasemissionen und Verringerung des CO<sub>2</sub>-Fußabdrucks;
2. Übergang zu oder die Nutzung von erneuerbarer Energie.

Der Teilfonds bezog die Identifizierung und Analyse der ESG-Referenzen eines Unternehmens als integralen Bestandteil in den Anlageentscheidungsprozess ein, um die Bewertung von Risiken und potenziellen Renditen zu unterstützen.

### ● Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Wir bestätigen, dass wir nachhaltige Vermögenswerte darauf geprüft haben, ob sie erhebliche Beeinträchtigungen verursachen können. Dies erfolgte im Rahmen des Standard-Anlageprozesses von HSBC Asset Management (HSBC) und unter Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen.

*Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?*

Der Anlageberater hat alle durch die Offenlegungsverordnung definierten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI) auf ihre Relevanz für den Teilfonds geprüft. Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren legt



fest, wie HSBC die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen identifiziert und darauf reagiert, und in welcher Form HSBC Nachhaltigkeitsrisiken berücksichtigt, die sich negativ auf Wertpapiere auswirken können, in die der Teilfonds investiert. HSBC identifizierte in Zusammenarbeit mit externen Screening-Dienstleistern, wie Sustainalytics, ISS, MSCI und Trucost, Unternehmen und Regierungen mit schlechter Bilanz beim Management von ESG-Risiken, und wo solche wesentlichen Risiken identifiziert wurden, führte HSBC zusätzliche ESG-Due-Diligence-Prüfungen durch. Durch Screening identifizierte Nachhaltigkeitsauswirkungen einschließlich der PAI bildeten einen Schlüsselfaktor beim Anlageentscheidungsprozess.

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 oben beschriebene Ansatz führte dazu, dass unter anderem folgende Faktoren geprüft wurden:

- Engagement der Unternehmen für den Übergang zu CO<sub>2</sub>-armen Wirtschaften, zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern, Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus großen Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails; und
- Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit folgenden Bereichen: demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.

Die spezifischen PAI für diesen Teilfonds waren wie unten beschrieben.

Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren ist auf der Website [www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies](http://www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies) verfügbar.

*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:*

HSBC hat sich der Anwendung und Förderung globaler Standards verpflichtet. Die wichtigsten Schwerpunktbereiche der Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren entsprachen den zehn UNGC-Grundsätzen. Diese Grundsätze stehen in Zusammenhang mit nicht finanziellen Risiken in den Bereichen Menschenrechte, Arbeit, Umweltschutz und Korruptionsbekämpfung. HSBC gehört darüber hinaus zu den Unterzeichnern der UN Principles for Responsible Investment. Diese bildeten den Rahmen für Ermittlung und Management von Nachhaltigkeitsrisiken beim Investmentansatz von HSBC.

Von Unternehmen, in die der Teilfonds investierte, wurde erwartet, dass sie die Anforderungen des UNGC und der damit verbundenen Standards erfüllen. Unternehmen, die belegbar gegen einen der zehn Grundsätze des UNGC verstießen, wurden systematisch ausgeschlossen. Der Teilfonds führte verstärkte Due-Diligence-Prüfungen bei Unternehmen durch, die als nicht konform mit den Prinzipien des UNGC angesehen wurden oder die nach den

unternehmenseigenen ESG Ratings von HSBC als risikoreich angesehen wurden. Darüber hinaus wurden die Unternehmen nach internationalen Standards wie den OECD-Leitsätzen bewertet.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen. Hierbei gelten spezifische von der Union definierte Kriterien.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*



### **Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Der Teilfonds berücksichtigte die folgenden PAI, indem er sie als Nachhaltigkeitsindikatoren beobachtete:

- Treibhausgasemissionen (Scope 1 und Scope 2)
- CO<sub>2</sub>-Fußabdruck (Scope 1 und Scope 2)
- Treibhausgasintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1 und Scope 2)
- Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
- Verstöße gegen die UNGC- und OECD-Grundsätze; und
- Anteil der Investitionen mit Beteiligung an umstrittenen Waffen

Der Ansatz zur Berücksichtigung der PAI beinhaltete unter anderem, dass HSBC das Engagement der Unternehmen für den Übergang zu CO<sub>2</sub>-armen Wirtschaften, die zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern sowie die Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette prüfte, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails. Ebenfalls berücksichtigt wurde das Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit den Bereichen demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung. Ausgeschlossen waren auch Unternehmen, deren Geschäftsaktivitäten als umweltschädlich eingestuft wurden.

Das Screening führte dazu, dass HSBC nicht in bestimmte Unternehmen und Emittenten investierte.



## Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der Investitionen** entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden: basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des Bezugszeitraums zum 31.03.2024

| Größte Investitionen                | Sektor                  | % der Land Vermögenswerte |
|-------------------------------------|-------------------------|---------------------------|
| HSBC US Dollar Liquidity Y 10116567 | Andere                  | 3,01 % Irland             |
| Alchip Technologies Ltd.            | Informationstechnologie | 2,48 % Taiwan             |
| Lendlease Global Commercial REIT    | Immobilien              | 2,10 % Singapur           |
| KEI Industries Limited              | Industriegüter          | 1,97 % Indien             |
| PT Pakuwon Jati Tbk                 | Immobilien              | 1,87 % Indonesien         |
| Route Mobile, Ltd.                  | Informationstechnologie | 1,77 % Indien             |
| Yageo Corporation                   | Informationstechnologie | 1,74 % Taiwan             |
| SINBON Electronics Co., Ltd.        | Informationstechnologie | 1,65 % Taiwan             |
| Asia Vital Components Co., Ltd.     | Informationstechnologie | 1,60 % Taiwan             |
| Five-Star Business Finance Limited  | Finanzen                | 1,55 % Indien             |
| Makalot Industrial Co., Ltd.        | Zyklische Konsumgüter   | 1,55 % Taiwan             |
| Nien Made Enterprise Co., Ltd.      | Zyklische Konsumgüter   | 1,54 % Taiwan             |
| POYA International Co., Ltd.        | Zyklische Konsumgüter   | 1,45 % Taiwan             |
| Unimicron Technology Corp.          | Informationstechnologie | 1,42 % Taiwan             |
| Gokaldas Exports Limited            | Zyklische Konsumgüter   | 1,36 % Indien             |

Barmittel und Derivate wurden nicht berücksichtigt

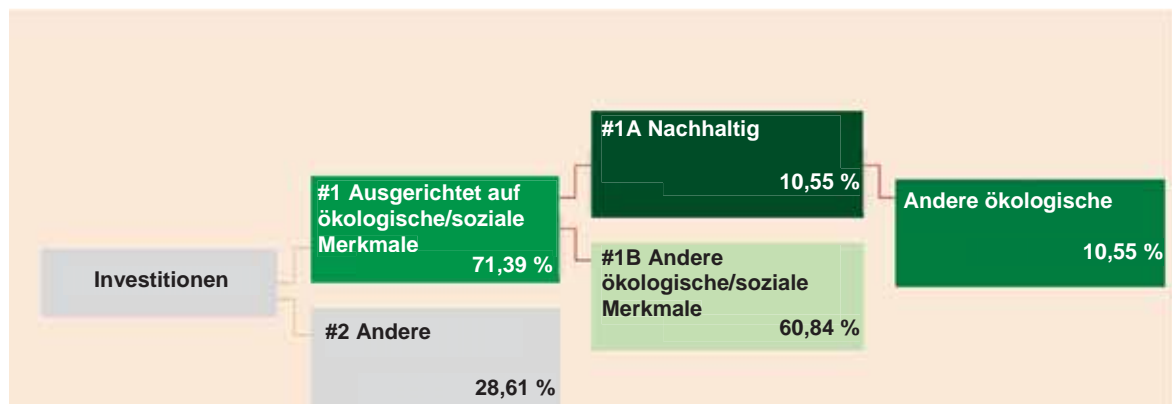


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

10,55 % des Portfolios waren in nachhaltige Vermögenswerte investiert.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?



**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**#2 Andere Investitionen** umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

## In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

| Sektor / Teilsektor                                   | % der Vermögenswerte |
|---|----------------------|
| Informationstechnologie                               | 23,82 %              |
| Zyklische Konsumgüter                                 | 18,02 %              |
| Industriegüter  | 14,49 %              |
| Gesundheitswesen                                      | 10,62 %              |
| Finanzen  | 8,37 %               |
| Immobilien  | 8,22 %               |
| Grundstoffe   | 4,96 %               |
| Andere  | 3,62 %               |
| Barmittel und Derivate                                | 2,01 %               |
| Basiskonsumgüter                                      | 1,91 %               |
| Energie   | 1,74 %               |
| <i>Ausrüstung und Dienstleistungen für Öl und Gas</i> | 1,20 %               |
| <i>Raffination und Vertrieb von Öl und Gas</i>        | 0,55 %               |
| Kommunikationsdienstleistungen                        | 1,37 %               |
| Versorger   | 0,77 %               |
| <i>Erdgas</i>   | 0,77 %               |
| Staatsanleihen  | 0,08 %               |
| Summe   | 100,00 %             |



## Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

Der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen lag bei 0 %. Der Teilfonds hat sich nicht verpflichtet, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen.

## Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonmiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

- Ja:
  In fossiles Gas
  In Kernenergie
- Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonmiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonmiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Kraftstoffe bis Ende 2035.

Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen.

- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

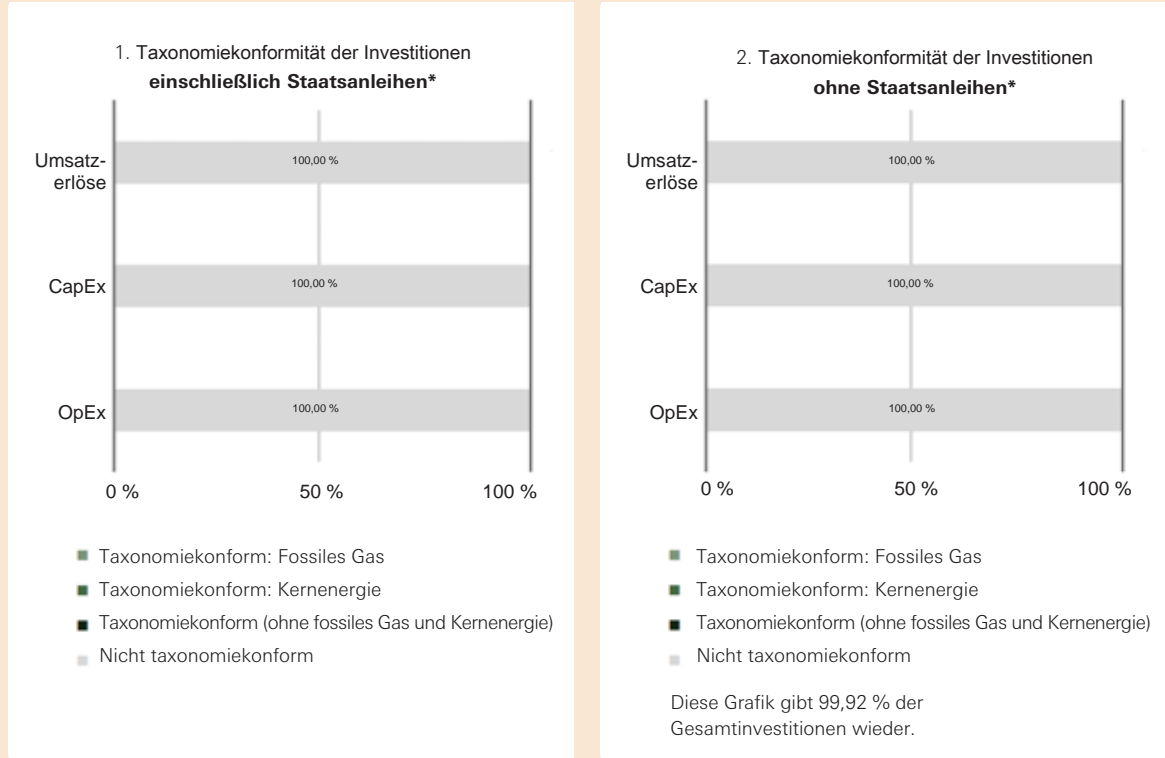
### Übergangstätigkeiten

sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

### Ermöglichende Tätigkeiten

wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

**Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.**



\* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

### Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Im Referenzzeitraum betrug der Anteil der Investitionen des Fonds, die in Übergangstätigkeiten geflossen sind, 0,00 % und der Anteil der Investitionen, die in ermöglichende Tätigkeiten geflossen ist, 0,00 %.

### Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

| Indikator   | 2023-2024 | 2022-2023 |
|---|-----------|-----------|
| Umsatz – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                       | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform: Kernenergie                        | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie) | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Nicht taxonomiekonform                               | 100,00 %  | 100,00 %  |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                        | n. z.     | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                         | n. z.     | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)  | n. z.     | 0,00 %    |
| CAPEX – Nicht taxonomiekonform                                | 100,00 %  | 100,00 %  |
| OPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                         | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                          | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)   | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Nicht taxonomiekonform                                 | 100,00 %  | 100,00 %  |

Da es sich erst um den zweiten Berichtszeitraum des Teilfonds handelt, ist ein Vergleich mit der Zeit davor nicht erforderlich.



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?**

Der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel war 10,55 %. Der Teilfonds hat sich nicht verpflichtet, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen.



### **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Teilfonds investierte nicht in sozial nachhaltige Anlagen.



### **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

#2 Andere Investitionen umfasst die Finanzinstrumente, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden. In manchen Fällen ist dies auf die Nichtverfügbarkeit von Daten und Unternehmensmaßnahmen zurückzuführen. Diese Positionen unterlagen nach wie vor dem vollständigen Ausschluss-Screening von HSBC und wurden im Hinblick auf verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Prinzipien des UNGC und der OECD geprüft.

Der Teilfonds hielt Barmittel / Barmitteläquivalente (der Prozentsatz der gehaltenen Barmittel ist in der obigen Tabelle der Sektoren/Teilektoren unter der Überschrift „In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?“ ersichtlich) zum Zwecke des Liquiditätsmanagements sowie derivative Finanzinstrumente zum Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements. Barmittel / Barmitteläquivalente und derivative Finanzinstrumente verfügen aufgrund der Art dieser Instrumente über keinen ökologischen oder sozialen Mindestschutz.



### **Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?**

Im Laufe des Berichtszeitraums schloss der Anlageberater unter anderem verbotene Waffen, umstrittene Waffen, Unternehmen, die mehr als 10 % ihres Umsatzes aus Kraftwerkskohle und Energieerzeugung aus Kohle generieren, und Tabakherstellung aus und investierte in Unternehmen mit verantwortungsvollen Geschäftspraktiken gemäß den Prinzipien des UNGC.

Alle Positionen im Portfolio wurden hinsichtlich ihrer individuellen Kohlenstoffintensität untersucht, was zu einer Kohlenstoffintensität des Portfolios führte, die besser als die des Referenzwerts war. Der Teilfonds bewertete auch ESG-Scores mit dem Ergebnis, dass der ESG-Score während des gesamten Berichtszeitraums über dem des Referenzwerts lag.

Wurden außerdem wesentliche ESG-Risiken oder ein potenzieller Verstoß gegen einen oder mehrere der 10 Prinzipien des UNGC festgestellt, führte der Portfoliomanager/Analyst eine intensive Due-Diligence-Prüfung in Bezug auf ESG-Themen durch und holte die Genehmigung des Investitionsausschusses ein, bevor Investitionen getätigt werden konnten.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend.

- *Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?*

Nicht zutreffend.

- *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?*

Nicht zutreffend.

- *Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?*

Nicht zutreffend.

- *Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?*

Nicht zutreffend.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen 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.

**Name des Produkts:** HSBC GLOBAL INVESTMENT FUNDS - ASIA PACIFIC EX JAPAN EQUITY HIGH DIVIDEND

**Unternehmenskennung (LEI-Code):** 213800MMWTNUVALJY871

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

| ●● <input type="checkbox"/> Ja  | ●○ <input checked="" type="checkbox"/> Nein   |
|---|---|
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel</b> getätigt: _ % <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> </ul> | <input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit <b>ökologische/soziale Merkmale beworben</b> und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 25,72 % an nachhaltigen Investitionen <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel</li> </ul> |
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel</b> getätigt: _ %   | <input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine <b>nachhaltigen Investitionen getätigt</b>   |



### Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Während des am 31. März 2024 endenden Geschäftsjahres (der Bezugszeitraum) hat der Teilfonds Folgendes beworben:

1. Es wurde auf das Erreichen eines ESG-Score des Teilfonds hingearbeitet, der über dem vom Teilfonds ausgewählten Referenzindex liegt (ein höherer Score als der Referenzwert bedeutet bessere ESG-Referenzen).
2. Der Teilfonds prüfte und analysierte alle Unternehmen oder Emittenten im Hinblick auf ökologische Merkmale, insbesondere physische Risiken durch den Klimawandel und

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.



Personalmanagement. Für die zugrunde liegenden E-, S- und G-Säulen wurden ein Screening sowie ein Vergleich mit dem für den Teilfonds definierten Referenzwert durchgeführt. „E“ und „S“ spiegeln die einzelnen Elemente der vom Teilfonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale wider, „G“ die Unternehmensführungspraktiken, die die Interessen von Minderheitsaktionären schützen und eine langfristige nachhaltige Wertschöpfung fördern.

3. Der Teilfonds berücksichtigte verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Grundsätzen des Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC) und den Leitsätzen für multinationale Unternehmen der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für Unternehmen. Wurden potenzielle Verstöße gegen die Prinzipien des UNGC festgestellt, wurden die Emittenten einer eigenen Due-Diligence-Prüfung hinsichtlich ESG-Themen unterzogen, um festzustellen, ob sie für die Aufnahme in das Portfolio des Teilfonds geeignet sind, und sie auszuschließen, falls sie als ungeeignet erachtet wurden.
4. Der Teilfonds schloss Geschäftstätigkeiten aus, die als umweltschädlich gelten, wie z. B. die Förderung von Kraftwerkskohle und die Kohleverstromung.
5. Der Teilfonds berücksichtigte aktiv ökologische und soziale Aspekte, indem er über unsere Engagement- und Stewardship-Teams Mitwirkung bei Emittenten umsetzte und sein Recht zur Stimmrechtsvertretung wahrnahm.
6. Der Teilfonds schloss nach entsprechender Analyse Anlagen in umstrittenen Waffen aus.

Die auf ESG und Nachhaltigkeitsindikatoren bezogenen Scores werden anhand der proprietären Methodik von HSBC Asset Management und externer ESG-Datenanbieter berechnet. Die Berücksichtigung einzelner (in der nachstehenden Tabelle nummerierter) wichtigster nachteiliger Auswirkungen (PAI) drückt sich darin aus, dass der Teilfonds niedrigere Werte als der Referenzwert aufweist. Die bei der Berechnung der PAI-Werte verwendeten Daten stammen von externen Datenanbietern. Sie können auf Unternehmensangaben basieren oder von den Datenanbietern geschätzt werden, wo keine solchen Angaben vorliegen. Bitte beachten Sie, dass es nicht immer möglich ist, die Richtigkeit, Aktualität oder Vollständigkeit der von Drittanbietern bereitgestellten Daten zu garantieren.

Der Teilfonds wurde aktiv verwaltet und bildete keinen Referenzwert nach. Ein internes oder externes Ziel des Teilfonds bestand im Übertreffen des Referenzwerts, der jedoch nicht zum Erreichen der vom Teilfonds beworbenen ökologischen Merkmale diente.

Das Abschneiden der Nachhaltigkeitsindikatoren, die der Teilfonds zur Messung der Erreichung der von ihm beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet, ist in der folgenden Tabelle dargestellt.

Alle Unternehmen/Emittenten haben eine gute Unternehmensführung bewiesen, was sich am PAI-Score 10 unten ablesen lässt.

### **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

| <b>Indikator</b>   | <b>Teilfonds</b> | <b>Referenzwert</b> |
|--|------------------|---------------------|
| 1. THG-Emissionen – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente  | 40.814,21        | 955.245.595,07      |
| 2. CO <sub>2</sub> -Fußabdruck – Tonnen CO <sub>2</sub> pro Million Euro (EVIC)  | 129,29           | 145,01              |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente pro Million Euro Umsatz   | 225,64           | 297,61              |
| 4. Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind   | 3,71 %           | 5,81 %              |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 4,42 %           | 5,82 %              |

|  |        |        |
|--|--------|--------|
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) | 0,00 % | 0,00 % |
|--|--------|--------|

Die Daten in diesem regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung beziehen sich auf den Stand vom 31. März 2024, basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des am 31. März 2024 endenden Geschäftsjahres.

Referenzwert – MSCI All Country Asia Pacific Ex-Japan

### **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

| Indikator  | Zeitraum zum  | Teilfonds | Referenzwert     |
|--|---------------|-----------|------------------|
| 1. THG-Emissionen – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente  | 31. März 2024 | 40.814,21 | 955.245.595,07   |
|  | 31. März 2023 | 50.526,67 | 1.093.496.502,73 |
| 2. CO <sub>2</sub> -Fußabdruck – Tonnen CO <sub>2</sub> pro Million Euro (EVIC)  | 31. März 2024 | 129,29    | 145,01           |
|  | 31. März 2023 | 133,21    | 162,10           |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente pro Million Euro Umsatz   | 31. März 2024 | 225,64    | 297,61           |
|  | 31. März 2023 | 316,65    | 323,44           |
| 4. Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind   | 31. März 2024 | 3,71 %    | 5,81 %           |
|  | 31. März 2023 | 4,66 %    | 5,55 %           |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 31. März 2024 | 4,42 %    | 5,82 %           |
|  | 31. März 2023 | 4,25 %    | 6,38 %           |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 31. März 2024 | 0,00 %    | 0,00 %           |
|  | 31. März 2023 | 0,00 %    | 0,02 %           |

Da es sich erst um den zweiten regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung handelt, ist kein Vergleich mit vorangegangenen Zeiträumen möglich.

### **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die vom Teilfonds getätigten nachhaltigen Investitionen trugen unter anderem zu folgenden ökologischen Zielen bei:

1. Reduzierung von Treibhausgasemissionen und Verringerung des CO<sub>2</sub>-Fußabdrucks;
2. Übergang zu oder die Nutzung von erneuerbarer Energie.

Der Teilfonds bezog die Identifizierung und Analyse der ESG-Referenzen eines Unternehmens als integralen Bestandteil in den Anlageentscheidungsprozess ein, um die Bewertung von Risiken und potenziellen Renditen zu unterstützen. Der Teilfonds beinhaltete die Identifizierung und Analyse von ESG-Referenzen eines Unternehmens als wesentlichen Bestandteil des Anlageentscheidungsprozesses mit dem Ziel der Reduzierung von Nachhaltigkeitsrisiken und Steigerung von Renditen.

### **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Wir bestätigen, dass wir nachhaltige Vermögenswerte darauf geprüft haben, ob sie erhebliche Beeinträchtigungen verursachen können. Dies erfolgte im Rahmen des Standard-Anlageprozesses von HSBC Asset Management (HSBC) und unter Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen.

## *Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?*

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 Anlageberater hat alle durch die Offenlegungsverordnung definierten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI) auf ihre Relevanz für den Teilfonds geprüft. Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren legt fest, wie HSBC die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen identifiziert und darauf reagiert, und in welcher Form HSBC Nachhaltigkeitsrisiken berücksichtigt, die sich negativ auf Wertpapiere auswirken können, in die der Teilfonds investiert. HSBC identifizierte in Zusammenarbeit mit externen Screening-Dienstleistern, wie Sustainalytics, ISS, MSCI und Trucost, Unternehmen und Regierungen mit schlechter Bilanz beim Management von ESG-Risiken, und wo solche wesentlichen Risiken identifiziert wurden, führte HSBC zusätzliche ESG-Due-Diligence-Prüfungen durch. Durch Screening identifizierte Nachhaltigkeitsauswirkungen einschließlich der PAI bildeten einen Schlüsselfaktor beim Anlageentscheidungsprozess.

Der oben beschriebene Ansatz führte dazu, dass unter anderem folgende Faktoren geprüft wurden:

- Engagement der Unternehmen für den Übergang zu CO2-armen Wirtschaften, zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern, Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus großen Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails; und
- Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit folgenden Bereichen: demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.

Die spezifischen PAI für diesen Teilfonds waren wie unten beschrieben.

Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren ist auf der Website [www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies](http://www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies) verfügbar.

*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:*

HSBC hat sich der Anwendung und Förderung globaler Standards verpflichtet. Die wichtigsten Schwerpunktbereiche der Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren entsprachen den zehn UNGC-Grundsätzen. Diese Grundsätze stehen in Zusammenhang mit nicht finanziellen Risiken in den Bereichen Menschenrechte, Arbeit, Umweltschutz und Korruptionsbekämpfung. HSBC gehört darüber hinaus zu den Unterzeichnern der UN Principles for Responsible Investment. Diese bildeten den Rahmen für Ermittlung und Management von Nachhaltigkeitsrisiken beim Investmentansatz von HSBC.

Von Unternehmen, in die der Teilfonds investierte, wurde erwartet, dass sie die Anforderungen des UNGC und der damit verbundenen Standards erfüllen. Unternehmen, die belegbar gegen einen der zehn Grundsätze des UNGC verstießen, wurden systematisch ausgeschlossen. Der Teilfonds führte verstärkte Due-Diligence-Prüfungen bei Unternehmen durch, die als nicht konform mit den Prinzipien des UNGC angesehen wurden oder die nach den unternehmenseigenen ESG Ratings von HSBC als risikoreich angesehen wurden. Darüber hinaus wurden die Unternehmen nach internationalen Standards wie den OECD-Leitsätzen bewertet.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen. Hierbei gelten spezifische von der Union definierte Kriterien.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*



### **Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Der Teilfonds berücksichtigte auch die nachfolgend aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen:

- Treibhausgasemissionen (Scope 1 und Scope 2)
- CO<sub>2</sub>-Fußabdruck (Scope 1 und Scope 2)
- Treibhausgasintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1 und Scope 2)
- Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
- Verstöße gegen die UNGC- und OECD-Grundsätze; und
- Anteil der Investitionen mit Beteiligung an umstrittenen Waffen

Der Ansatz zur Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen beinhaltete unter anderem, dass HSBC das Engagement der Unternehmen für den Übergang zu kohlenstoffarmem Wirtschaften, die zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern sowie die Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette prüfte, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails. Ebenfalls berücksichtigt wurde das Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit den Bereichen demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.

Ausgeschlossen waren auch Unternehmen, deren Geschäftsaktivitäten als umweltschädlich eingestuft wurden.

Das Screening führte dazu, dass HSBC nicht in bestimmte Unternehmen und Emittenten investierte.



## Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der Investitionen** entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden: basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des Bezugszeitraums zum 31.03.2024

| Größte Investitionen                                     | Sektor                         | % der Vermögenswerte Land |
|--|--------------------------------|---------------------------|
| Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd.             | Informationstechnologie        | 8,93 % Taiwan             |
| Baidu, Inc. Class A                                      | Kommunikationsdienstleistungen | 4,57 % China              |
| Samsung Electronics Co Ltd Pfd Non-Voting                | Informationstechnologie        | 4,26 % Korea              |
| Tingyi (Cayman Islands) Holding Corp.                    | Basiskonsumgüter               | 4,12 % China              |
| Santos Limited   | Energie                        | 3,81 % Australien         |
| Ping An Insurance (Group) Company of China, Ltd. Class H | Finanzen                       | 3,76 % China              |
| AIA Group Limited  | Finanzen                       | 3,67 % Hongkong           |
| South32 Ltd.   | Grundstoffe                    | 3,67 % Australien         |
| L'Occitane International S.A.                            | Basiskonsumgüter               | 3,58 % Luxemburg          |
| SK Square Co., Ltd.                                      | Industriegüter                 | 3,53 % Korea              |
| DBS Group Holdings Ltd                                   | Finanzen                       | 3,51 % Singapur           |
| PT Telkom Indonesia (Persero) Tbk Class B                | Kommunikationsdienstleistungen | 3,49 % Indonesien         |

Barmittel und Derivate wurden nicht berücksichtigt



## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

25,72 % des Portfolios waren in nachhaltige Vermögenswerte investiert.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?



Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

## ● In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

| Sektor / Teilsektor                              | % der Vermögenswerte |
|--|----------------------|
| Finanzen   | 26,72 %              |
| Informationstechnologie                          | 23,82 %              |
| Kommunikationsdienstleistungen                   | 14,97 %              |
| Basiskonsumgüter                                 | 9,20 %               |
| Grundstoffe                                      | 6,48 %               |
| Industriegüter                                   | 5,94 %               |
| Energie  | 3,99 %               |
| <i>Exploration und Produktion von Öl und Gas</i> | <i>3,71 %</i>        |
| Zyklische Konsumgüter                            | 2,93 %               |
| Versorger  | 1,82 %               |
| <i>Stromversorgungsbetriebe</i>                  | <i>1,82 %</i>        |
| Barmittel und Derivate                           | 1,41 %               |
| Andere   | 1,41 %               |
| Immobilien                                       | 1,27 %               |
| Staatsanleihen                                   | 0,03 %               |
| Summe  | 100,00 %             |

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Kraftstoffe bis Ende 2035.

Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der: **- Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



## Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

Der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen lag bei 0 %. Der Teilfonds hat sich nicht verpflichtet, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen.

### ● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

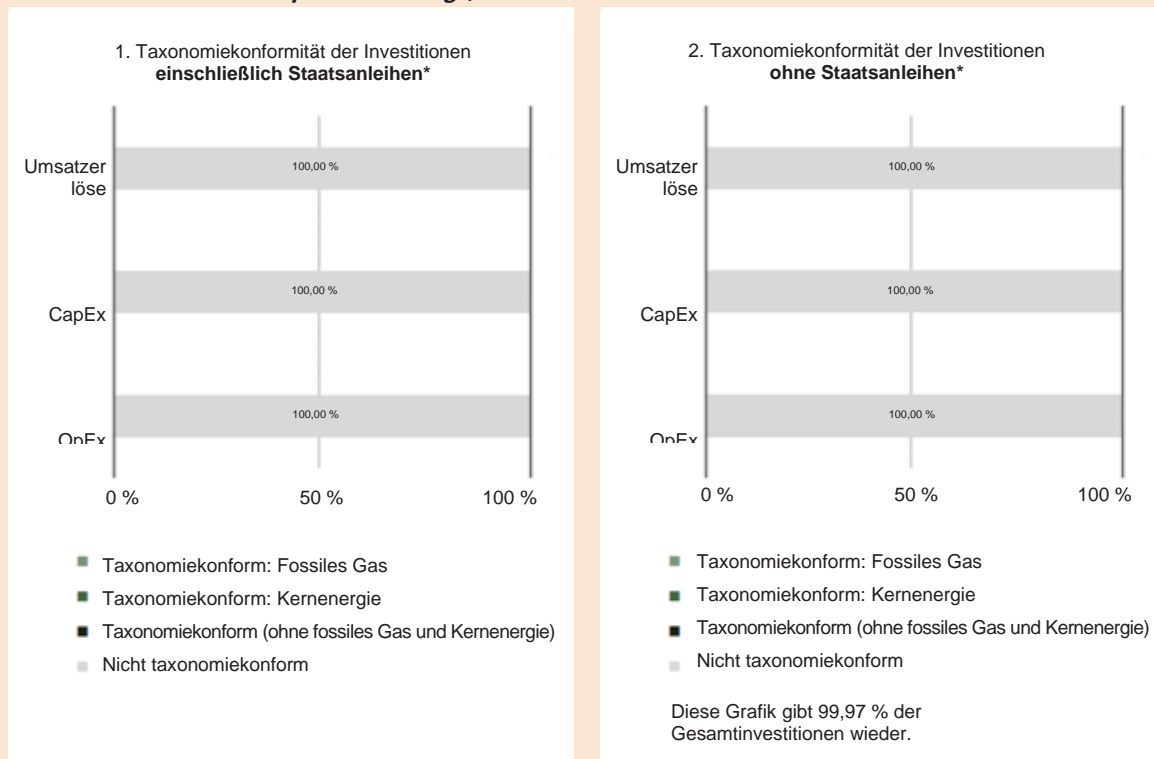
**- Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen.

**- Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

**Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten**, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

**Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.**



\* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

**Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Im Referenzzeitraum betrug der Anteil der Investitionen des Fonds, die in Übergangstätigkeiten geflossen sind, 0,00 % und der Anteil der Investitionen, die in ermöglichende Tätigkeiten geflossen ist, 0,00 %.

**Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

| Indikator   | 2023-2024 | 2022-2023 |
|---|-----------|-----------|
| Umsatz – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                       | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform: Kernenergie                        | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie) | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Nicht taxonomiekonform                               | 100,00 %  | 100,00 %  |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                        | n. z.     | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                         | n. z.     | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)  | n. z.     | 0,00 %    |
| CAPEX – Nicht taxonomiekonform                                | 100,00 %  | 100,00 %  |
| OPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                         | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                          | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)   | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Nicht taxonomiekonform                                 | 100,00 %  | 100,00 %  |

Da es sich erst um den zweiten Berichtszeitraum des Teilfonds handelt, ist ein Vergleich mit der Zeit davor nicht erforderlich.



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?**

Der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel war 25,72 %. Der Teilfonds hat sich nicht verpflichtet, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen.



### **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Teilfonds investierte nicht in sozial nachhaltige Anlagen.



### **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

#2 Andere Investitionen umfasst die Finanzinstrumente, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden. In manchen Fällen ist dies auf die Nichtverfügbarkeit von Daten und Unternehmensmaßnahmen zurückzuführen. Diese Positionen unterlagen nach wie vor dem vollständigen Ausschluss-Screening von HSBC und wurden im Hinblick auf verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Prinzipien des UNGC und der OECD geprüft.

Der Teilfonds hielt Barmittel / Barmitteläquivalente (der Prozentsatz der gehaltenen Barmittel ist in der obigen Tabelle der Sektoren/Teilektoren unter der Überschrift „In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?“ ersichtlich) zum Zwecke des Liquiditätsmanagements sowie derivative Finanzinstrumente zum Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements. Barmittel / Barmitteläquivalente und derivative Finanzinstrumente verfügen aufgrund der Art dieser Instrumente über keinen ökologischen oder sozialen Mindestschutz.



### **Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?**

Im Laufe des Berichtszeitraums schloss der Anlageberater unter anderem verbotene Waffen, umstrittene Waffen, Unternehmen, die mehr als 10 % ihres Umsatzes aus Kraftwerkskohle und Energieerzeugung aus Kohle generieren, und Tabakherstellung aus und investierte in Unternehmen mit verantwortungsvollen Geschäftspraktiken gemäß den Prinzipien des UNGC.

Alle Positionen im Portfolio wurden hinsichtlich ihrer individuellen Kohlenstoffintensität untersucht, was zu einer Kohlenstoffintensität des Portfolios führte, die besser als die des Referenzwerts war. Der Teilfonds bewertete auch ESG-Scores mit dem Ergebnis, dass der ESG-Score während des gesamten Berichtszeitraums über dem des Referenzwerts lag.

Wurden außerdem wesentliche ESG-Risiken oder ein potenzieller Verstoß gegen einen oder mehrere der 10 Prinzipien des UNGC festgestellt, führte der Portfoliomanager/Analyst eine intensive Due-Diligence-Prüfung in Bezug auf ESG-Themen durch und holte die Genehmigung des Investitionsausschusses ein, bevor Investitionen getätigt werden konnten.





## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Nicht zutreffend.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Nicht zutreffend.

- **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?**

Nicht zutreffend.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen 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.

**Name des Produkts:** HSBC GLOBAL INVESTMENT FUNDS - CHINA A-SHARES EQUITY

**Unternehmenskennung (LEI-Code):** 213800ZAVP5VLFDBBN34

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

| ●● <input type="checkbox"/> Ja  | ●● <input checked="" type="checkbox"/> Nein   |
|---|---|
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: _ %</b> <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> </ul> | <input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit <b>ökologische/soziale Merkmale beworben</b> und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 10,47 % an nachhaltigen Investitionen <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel</li> </ul> |
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: _ %</b>   | <input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine <b>nachhaltigen Investitionen getätigt</b>   |



### Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Während des am 31. März 2024 endenden Geschäftsjahres (der Bezugszeitraum) hat der Teilfonds Folgendes beworben:

1. Aktive Berücksichtigung von Investitionen mit geringer CO<sub>2</sub>-Intensität im Vergleich zum Referenzwert.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

2. Der Teilfonds prüfte und analysierte alle Unternehmen oder Emittenten im Hinblick auf ökologische Merkmale, insbesondere physische Risiken durch den Klimawandel und Personalmanagement. Für die zugrunde liegenden E-, S- und G-Säulen wurde ein Screening durchgeführt. „E“ und „S“ spiegeln die einzelnen Elemente der vom Teilfonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale wider, „G“ die Unternehmensführungspraktiken, die die Interessen von Minderheitsaktionären schützen und eine langfristige nachhaltige Wertschöpfung fördern.
3. Der Teilfonds berücksichtigte verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Grundsätzen des Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC) und den Leitsätzen für multinationale Unternehmen der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für Unternehmen. Wurden potenzielle Verstöße gegen die Prinzipien des UNGC festgestellt, wurden die Emittenten einer eigenen Due-Diligence-Prüfung hinsichtlich ESG-Themen unterzogen, um festzustellen, ob sie für die Aufnahme in das Portfolio des Teilfonds geeignet sind, und sie auszuschließen, falls sie als ungeeignet erachtet wurden.
4. Der Teilfonds schloss Geschäftstätigkeiten aus, die als umweltschädlich gelten, wie z. B. die Förderung von Kraftwerkskohle und die Kohleverstromung.
5. Der Teilfonds berücksichtigte aktiv ökologische und soziale Aspekte, indem er über unsere Engagement- und Stewardship-Teams Mitwirkung bei Emittenten umsetzte und sein Recht zur Stimmrechtsvertretung wahrnahm.
6. Der Teilfonds schloss nach entsprechender Analyse Anlagen in umstrittenen Waffen aus.

Die auf Nachhaltigkeitsindikatoren bezogenen Scores werden anhand der proprietären Methodik von HSBC Asset Management und externer ESG-Datenanbieter berechnet. Die Berücksichtigung einzelner (in der nachstehenden Tabelle nummerierter) wichtigster nachteiliger Auswirkungen (PAI) drückt sich darin aus, dass der Teilfonds niedrigere Werte als der Referenzwert aufweist. Die bei der Berechnung der PAI-Werte verwendeten Daten stammen von externen Datenanbietern. Sie können auf Unternehmensangaben basieren oder von den Datenanbietern geschätzt werden, wo keine solchen Angaben vorliegen. Bitte beachten Sie, dass es nicht immer möglich ist, die Richtigkeit, Aktualität oder Vollständigkeit der von Drittanbietern bereitgestellten Daten zu garantieren.

Der Referenzwert wurde zur Messung der Kohlenstoffintensität des Teilfonds herangezogen, diente aber nicht der Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale des Teilfonds.

Das Abschneiden der Nachhaltigkeitsindikatoren, die der Teilfonds zur Messung der Erreichung der von ihm beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet, ist in der folgenden Tabelle dargestellt.

Alle Unternehmen haben eine gute Unternehmensführung bewiesen, was sich am PAI-Score 10 unten ablesen lässt.

### **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

| <b>Indikator</b>   | <b>Teilfonds</b> | <b>Referenzwert</b> |
|--|------------------|---------------------|
| 1. THG-Emissionen – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente  | 3.023,25         | 578.317.891,26      |
| 2. CO <sub>2</sub> -Fußabdruck – Tonnen CO <sub>2</sub> pro Million Euro (EVIC)  | 141,19           | 212,82              |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente pro Million Euro Umsatz   | 184,41           | 313,94              |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 0,00 %           | 1,67 %              |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen,  | 0,00 %           | 0,09 %              |

Die Daten in diesem regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung beziehen sich auf den Stand vom 31. März 2024, basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des am 31. März 2024 endenden Geschäftsjahres.

Referenzwert - MSCI China A Onshore

### **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

| <b>Indikator</b>   | <b>Zeitraum zum</b> | <b>Teilfonds</b> | <b>Referenzwert</b> |
|--|---------------------|------------------|---------------------|
| 1. THG-Emissionen – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente  | 31. März 2024       | 3.023,25         | 578.317.891,26      |
|  | 31. März 2023       | 9.261,79         | 675.133.162,68      |
| 2. CO <sub>2</sub> -Fußabdruck – Tonnen CO <sub>2</sub> pro Million Euro (EVIC)  | 31. März 2024       | 141,19           | 212,82              |
|  | 31. März 2023       | 480,16           | 192,54              |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente pro Million Euro Umsatz   | 31. März 2024       | 184,41           | 313,94              |
|  | 31. März 2023       | 371,54           | 380,26              |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 31. März 2024       | 0,00 %           | 1,67 %              |
|  | 31. März 2023       | 0,00 %           | 1,64 %              |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 31. März 2024       | 0,00 %           | 0,09 %              |
|  | 31. März 2023       | 1,32 %           | 1,07 %              |

Da es sich erst um den zweiten regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung handelt, ist kein Vergleich mit vorangegangenen Zeiträumen möglich.

### **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die vom Teilfonds getätigten nachhaltigen Investitionen trugen unter anderem zu folgenden ökologischen Zielen bei:

1. Reduzierung von Treibhausgasemissionen und Verringerung des CO<sub>2</sub>-Fußabdrucks;
2. Übergang zu oder die Nutzung von erneuerbarer Energie.

Der Teilfonds bezog die Identifizierung und Analyse der ESG-Referenzen eines Unternehmens als integralen Bestandteil in den Anlageentscheidungsprozess ein, um die Bewertung von Risiken und potenziellen Renditen zu unterstützen. Der Teilfonds beinhaltet die Identifizierung und Analyse von ESG-Referenzen eines Unternehmens als wesentlichen Bestandteil des Anlageentscheidungsprozesses mit dem Ziel der Reduzierung von Nachhaltigkeitsrisiken und Steigerung von Renditen.

### **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Wir bestätigen, dass wir nachhaltige Vermögenswerte darauf geprüft haben, ob sie erhebliche Beeinträchtigungen verursachen können. Dies erfolgte im Rahmen des Standard-Anlageprozesses von HSBC Asset Management (HSBC) und unter Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen.

*Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?*

Der Anlageberater hat alle durch die Offenlegungsverordnung definierten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI) auf ihre Relevanz für den Teilfonds geprüft. Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren legt fest, wie HSBC die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen identifiziert und darauf reagiert, und in welcher Form HSBC Nachhaltigkeitsrisiken berücksichtigt, die sich negativ auf Wertpapiere auswirken können, in die der Teilfonds investiert. HSBC identifizierte in Zusammenarbeit mit externen Screening-Dienstleistern, wie Sustainalytics, ISS, MSCI und Trucost, Unternehmen und Regierungen mit schlechter Bilanz beim Management von ESG-Risiken, und wo solche wesentlichen Risiken identifiziert wurden, führte HSBC zusätzliche ESG-Due-Diligence-Prüfungen durch. Durch Screening identifizierte Nachhaltigkeitsauswirkungen einschließlich der PAI bildeten einen Schlüsselfaktor beim Anlageentscheidungsprozess.

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 oben beschriebene Ansatz führte dazu, dass unter anderem folgende Faktoren geprüft wurden:

- Engagement der Unternehmen für den Übergang zu CO2-armen Wirtschaften, zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern, Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus großen Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails; und
- Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit folgenden Bereichen: demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.

Die spezifischen PAI für diesen Teilfonds waren wie unten beschrieben.

Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren ist auf der Website [www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies](http://www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies) verfügbar.

*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:*

HSBC hat sich der Anwendung und Förderung globaler Standards verpflichtet. Die wichtigsten Schwerpunktbereiche der Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren entsprachen den zehn UNGC-Grundsätzen. Diese Grundsätze stehen in Zusammenhang mit nicht finanziellen Risiken in den Bereichen Menschenrechte, Arbeit, Umweltschutz und Korruptionsbekämpfung. HSBC gehört darüber hinaus zu den Unterzeichnern der UN Principles for Responsible Investment. Diese bildeten den Rahmen für Ermittlung und Management von Nachhaltigkeitsrisiken beim Investmentansatz von HSBC. Von Unternehmen, in die der Teilfonds investierte, wurde erwartet, dass sie die Anforderungen des UNGC und der damit verbundenen Standards erfüllen. Unternehmen, die belegbar gegen einen der zehn Grundsätze des UNGC verstießen, wurden systematisch ausgeschlossen. Der Teilfonds führte verstärkte

Due-Diligence-Prüfungen bei Unternehmen durch, die als nicht konform mit den Prinzipien des UNGC angesehen wurden oder die nach den unternehmenseigenen ESG Ratings von HSBC als risikoreich angesehen wurden. Darüber hinaus wurden die Unternehmen nach internationalen Standards wie den OECD-Leitsätzen bewertet.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen. Hierbei gelten spezifische von der Union definierte Kriterien.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*



### **Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Der Teilfonds berücksichtigte die folgenden PAI, indem er sie als Nachhaltigkeitsindikatoren beobachtete:

- Treibhausgasemissionen (Scope 1 und Scope 2)
- CO<sub>2</sub>-Fußabdruck (Scope 1 und Scope 2)
- Treibhausgasintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1 und Scope 2)
- Verstöße gegen die UNGC- und OECD-Grundsätze; und
- Anteil der Investitionen mit Beteiligung an umstrittenen Waffen

Der Ansatz zur Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen beinhaltete unter anderem, dass HSBC das Engagement der Unternehmen für den Übergang zu kohlenstoffarmem Wirtschaften, die zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern sowie die Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette prüfte, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails. Ebenfalls berücksichtigt wurde das Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit den Bereichen demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung. Ausgeschlossen waren auch Unternehmen, deren Geschäftsaktivitäten als umweltschädlich eingestuft wurden.

Das Screening führte dazu, dass HSBC nicht in bestimmte Unternehmen und Emittenten investierte.



## Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der Investitionen** entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden: basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des Bezugszeitraums zum 31.03.2024

| Größte Investitionen                                      | Sektor                  | % der Vermögenswerte Land |
|---|-------------------------|---------------------------|
| Kweichow Moutai Co., Ltd. Class A                         | Basiskonsumgüter        | 5,10 % China              |
| Luxshare Precision Industry Co. Ltd. Class A              | Informationstechnologie | 4,21 % China              |
| Contemporary Amperex Technology Co., Ltd. Class A         | Industriegüter          | 3,99 % China              |
| Agricultural Bank of China Limited Class A                | Finanzen                | 3,25 % China              |
| Yantai Jereh Oilfield Services Group Co., Ltd. Class A    | Energie                 | 3,02 % China              |
| Bank of Jiangsu Co., Ltd. Class A                         | Finanzen                | 3,00 % China              |
| Ningbo Orient Wires & Cables Co Ltd Class A               | Industriegüter          | 2,61 % China              |
| Postal Savings Bank of China Co., Ltd. Class A            | Finanzen                | 2,42 % China              |
| CNOOC Limited Class A                                     | Energie                 | 2,38 % China              |
| Guotai Junan Securities Co., Ltd. Class A                 | Finanzen                | 2,38 % China              |
| Weichai Power Co., Ltd. Class A                           | Industriegüter          | 2,34 % China              |
| TCL Technology Group Corporation Class A                  | Zyklische Konsumgüter   | 2,23 % China              |
| Midea Group Co. Ltd. Class A                              | Zyklische Konsumgüter   | 2,20 % China              |
| Ping An Insurance (Gruppe) Company of China, Ltd. Class A | Finanzen                | 2,17 % China              |
| Shandong Nanshan Aluminium Co., Ltd. Class A              | Grundstoffe             | 1,92 % China              |

Barmittel und Derivate wurden nicht berücksichtigt

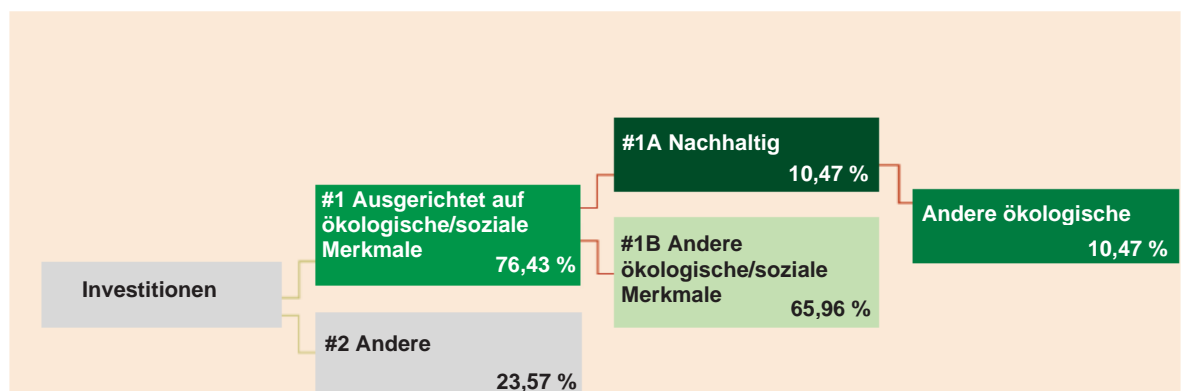


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

10,47 % des Portfolios waren in nachhaltige Vermögenswerte investiert.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?



**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale** Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**#2 Andere Investitionen** umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale** Merkmale umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale** Merkmale umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

## In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

| Sektor / Teilsektor                            | % der Vermögenswerte |
|--|----------------------|
| Industriegüter                                 | 19,35 %              |
| Finanzen                                       | 18,87 %              |
| Informationstechnologie                        | 16,71 %              |
| Zyklische Konsumgüter                          | 9,44 %               |
| Grundstoffe                                    | 9,30 %               |
| Energie  | 8,18 %               |
| Öl- und Gasbohrungen                           | 0,25 %               |
| Ausrüstung und Dienstleistungen für Öl und Gas | 4,30 %               |
| Exploration und Produktion von Öl und Gas      | 2,03 %               |
| Raffination und Vertrieb von Öl und Gas        | 0,92 %               |
| Lagerung und Transport von Öl und Gas          | 0,69 %               |
| Basiskonsumgüter                               | 7,24 %               |
| Gesundheitswesen                               | 5,06 %               |
| Kommunikationsdienstleistungen                 | 3,01 %               |
| Versorger                                      | 2,31 %               |
| Unabhängige Stromerzeuger und Energiehändler   | 1,80 %               |
| Barmittel und Derivate                         | 0,52 %               |
| Summe  | 100,00 %             |



### Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

Der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen lag bei 0 %. Der Teilfonds hat sich nicht verpflichtet, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen.

### Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonmiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonmiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonmiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Mit Blick auf die EU-Taxonmiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die **Kriterien für Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Taxonmiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



**- Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen.

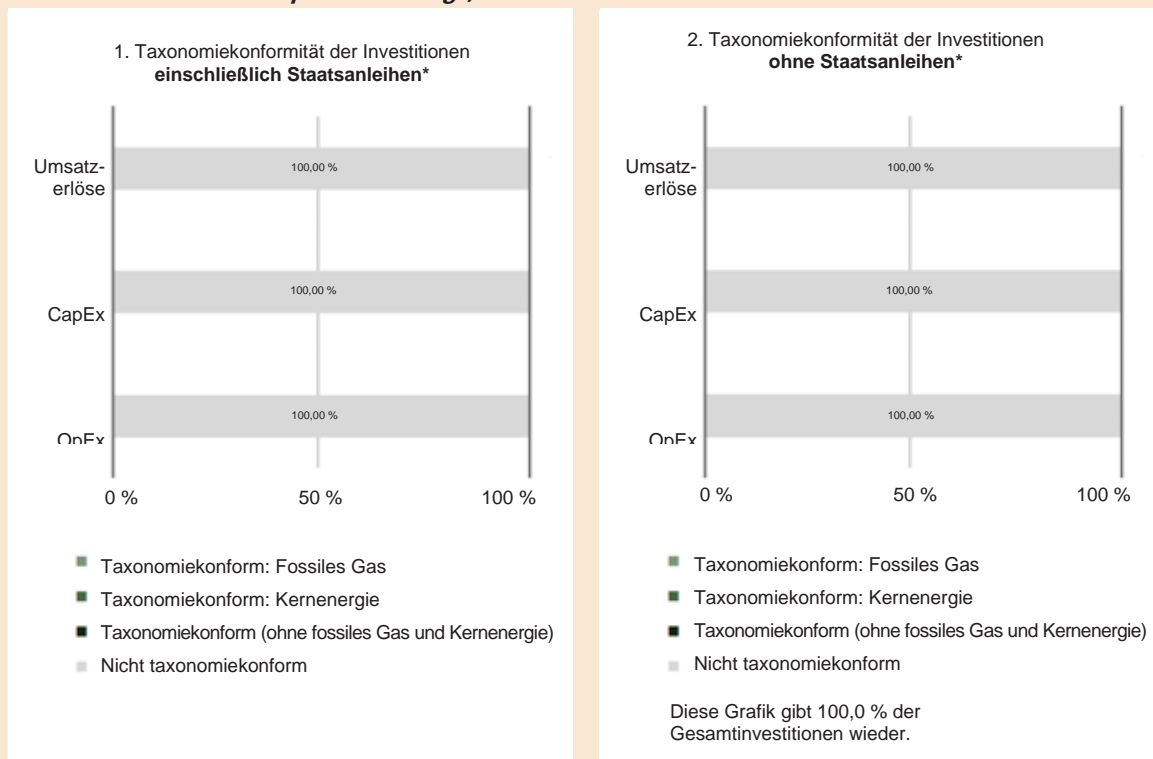
**- Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

**Übergangstätigkeiten** sind

Tätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

**Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.**



\* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

**Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Im Referenzzeitraum betrug der Anteil der Investitionen des Fonds, die in Übergangstätigkeiten geflossen sind, 0,00 % und der Anteil der Investitionen, die in ermöglichende Tätigkeiten geflossen ist, 0,00 %.

**Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

| Indikator   | 2023-2024 | 2022-2023 |
|---|-----------|-----------|
| Umsatz – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                       | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform: Kernenergie                        | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie) | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Nicht taxonomiekonform                               | 100,00 %  | 100,00 %  |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                        | n. z.     | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                         | n. z.     | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)  | n. z.     | 0,00 %    |
| CAPEX – Nicht taxonomiekonform                                | 100,00 %  | 100,00 %  |
| OPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                         | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                          | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)   | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Nicht taxonomiekonform                                 | 100,00 %  | 100,00 %  |

Da es sich erst um den zweiten Berichtszeitraum des Teilfonds handelt, ist ein Vergleich mit der Zeit davor nicht erforderlich.



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?**

Der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel war 10,47 %. Der Teilfonds hat sich nicht verpflichtet, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen.



### **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Teilfonds investierte nicht in sozial nachhaltige Anlagen.



### **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

#2 Andere Investitionen umfasst die Finanzinstrumente, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden. In manchen Fällen ist dies auf die Nichtverfügbarkeit von Daten und Unternehmensmaßnahmen zurückzuführen. Diese Positionen unterlagen nach wie vor dem vollständigen Ausschluss-Screening von HSBC und wurden im Hinblick auf verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Prinzipien des UNGC und der OECD geprüft.

Der Teilfonds hielt Barmittel / Barmitteläquivalente (der Prozentsatz der gehaltenen Barmittel ist in der obigen Tabelle der Sektoren/Teilsektoren unter der Überschrift „In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?“ ersichtlich) zum Zwecke des Liquiditätsmanagements sowie derivative Finanzinstrumente zum Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements. Barmittel / Barmitteläquivalente und derivative Finanzinstrumente verfügen aufgrund der Art dieser Instrumente über keinen ökologischen oder sozialen Mindestschutz.



### **Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?**

Im Laufe des Berichtszeitraums schloss der Anlageberater unter anderem verbotene Waffen, umstrittene Waffen, Unternehmen, die mehr als 10 % ihres Umsatzes aus Kraftwerkskohle und Energieerzeugung aus Kohle generieren, und Tabakherstellung aus und investierte in Unternehmen mit verantwortungsvollen Geschäftspraktiken gemäß den Prinzipien des UNGC.

Alle Positionen im Portfolio wurden hinsichtlich ihrer individuellen Kohlenstoffintensität untersucht, was zu einer Kohlenstoffintensität des Portfolios führte, die besser als die des Referenzwerts war. Der Teilfonds bewertete auch ESG-Scores mit dem Ergebnis, dass der ESG-Score während des gesamten Berichtszeitraums über dem des Referenzwerts lag.

Wurden außerdem wesentliche ESG-Risiken oder ein potenzieller Verstoß gegen einen oder mehrere der zehn Prinzipien des UNGC festgestellt, führte der Portfoliomanager/Analyst eine intensive Due-Diligence-Prüfung in Bezug auf ESG-Themen durch. Zudem war die Genehmigung des Investitionsausschusses erforderlich, bevor Investitionen getätigt werden konnten.



### **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

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?***  
Nicht zutreffend.
- ***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?***  
Nicht zutreffend.
- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?***  
Nicht zutreffend.
- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?***  
Nicht zutreffend.

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt,

vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen 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.

Name des Produkts: HSBC GLOBAL INVESTMENT FUNDS - CHINESE EQUITY

Unternehmenskennung (LEI-Code): 21380041N4NYFPYHPQ91

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

| ●● <input type="checkbox"/> Ja  | ●○ <input checked="" type="checkbox"/> Nein   |
|---|---|
| <p><input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: _ %</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> </ul> <p><input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: _ %</b></p> | <p><input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit <b>ökologische/soziale Merkmale beworben</b> und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 13,11 % an nachhaltigen Investitionen</p> <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel</li> </ul> <p><input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine <b>nachhaltigen Investitionen getätigt</b></p> |



### Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Während des am 31. März 2024 endenden Geschäftsjahres (der Bezugszeitraum) hat der Teilfonds Folgendes beworben:

1. Der Teilfonds prüfte und analysierte alle Unternehmen oder Emittenten im Hinblick auf ökologische Merkmale, insbesondere physische Risiken durch den Klimawandel und

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Personalmanagement. Für die zugrunde liegenden E-, S- und G-Säulen wurden ein Screening sowie ein Vergleich mit dem für den Teilfonds definierten Referenzwert durchgeführt. „E“ und „S“ spiegeln die einzelnen Elemente des vom Teilfonds beworbenen nachhaltigen Anlageziels wider, „G“ die Unternehmensführungspraktiken, die die Interessen von Minderheitsaktionären schützen und langfristige nachhaltige Wertschöpfung fördern.

2. Der Teilfonds berücksichtigte verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Grundsätzen des Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC) und den Leitsätzen für multinationale Unternehmen der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für Unternehmen. Wurden potenzielle Verstöße gegen die Prinzipien des UNGC festgestellt, wurden die Emittenten einer eigenen Due-Diligence-Prüfung hinsichtlich ESG-Themen unterzogen, um festzustellen, ob sie für die Aufnahme in das Portfolio des Teilfonds geeignet sind, und sie auszuschließen, falls sie als ungeeignet erachtet wurden.

3. Der Teilfonds schloss Geschäftstätigkeiten aus, die als umweltschädlich gelten, wie z. B. die Förderung von Kraftwerkskohle und die Kohleverstromung.

4. Der Teilfonds berücksichtigte aktiv ökologische und soziale Aspekte, indem er über unsere Engagement- und Stewardship-Teams Mitwirkung bei Emittenten umsetzte und sein Recht zur Stimmrechtsvertretung wahrnahm.

5. Der Teilfonds schloss nach entsprechender Analyse Anlagen in umstrittenen Waffen aus.

Die auf ESG und Nachhaltigkeitsindikatoren bezogenen Scores werden anhand der proprietären Methodik von HSBC Asset Management und externer ESG-Datenanbieter berechnet. Die Berücksichtigung einzelner (in der nachstehenden Tabelle nummerierter) wichtigster nachteiliger Auswirkungen (PAI) drückt sich darin aus, dass der Teilfonds niedrigere Werte als der Referenzwert aufweist. Die bei der Berechnung der PAI-Werte verwendeten Daten stammen von externen Datenanbietern. Sie können auf Unternehmensangaben basieren oder von den Datenanbietern geschätzt werden, wo keine solchen Angaben vorliegen. Bitte beachten Sie, dass es nicht immer möglich ist, die Richtigkeit, Aktualität oder Vollständigkeit der von Drittanbietern bereitgestellten Daten zu garantieren.

Der Teilfonds wurde aktiv verwaltet und bildete keinen Referenzwert nach. Ein internes oder externes Ziel des Teilfonds bestand im Übertreffen des Referenzwerts, der jedoch nicht zum Erreichen der vom Teilfonds beworbenen ökologischen Merkmale diente.

Das Abschneiden der Nachhaltigkeitsindikatoren, die der Teilfonds zur Messung der Erreichung der von ihm beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet, ist in der folgenden Tabelle dargestellt.

Alle Unternehmen/Emittenten haben eine gute Unternehmensführung bewiesen, was sich am PAI-Score 10 unten ablesen lässt.

### **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

| <b>Indikator</b>   | <b>Teilfonds</b> | <b>Referenzwert</b> |
|--|------------------|---------------------|
| 1. THG-Emissionen – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente  | 33.766,55        | 377.996.142,42      |
| 2. CO <sub>2</sub> -Fußabdruck – Tonnen CO <sub>2</sub> pro Million Euro (EVIC)  | 58,33            | 157,26              |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente pro Million Euro Umsatz   | 81,15            | 234,06              |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 11,69 %          | 15,33 %             |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 0,00 %           | 0,00 %              |

Die Daten in diesem regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung beziehen sich auf den Stand vom 31. März 2024, basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des am 31. März 2024 endenden Geschäftsjahres.

Referenzwert - MSCI China 10-40

### **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

| <b>Indikator</b>   | <b>Zeitraum zum</b> | <b>Teilfonds</b> | <b>Referenzwert</b> |
|--|---------------------|------------------|---------------------|
| 1. THG-Emissionen – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente  | 31. März 2024       | 33.766,55        | 377.996.142,42      |
|  | 31. März 2023       | 57.062,04        | 438.638.540,00      |
| 2. CO <sub>2</sub> -Fußabdruck – Tonnen CO <sub>2</sub> pro Million Euro (EVIC)  | 31. März 2024       | 58,33            | 157,26              |
|  | 31. März 2023       | 81,27            | 155,24              |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente pro Million Euro Umsatz   | 31. März 2024       | 81,15            | 234,06              |
|  | 31. März 2023       | 160,12           | 271,01              |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 31. März 2024       | 11,69 %          | 15,33 %             |
|  | 31. März 2023       | 13,33 %          | 15,04 %             |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 31. März 2024       | 0,00 %           | 0,00 %              |
|  | 31. März 2023       | 0,00 %           | 0,08 %              |

Da es sich erst um den zweiten regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung handelt, ist kein Vergleich mit vorangegangenen Zeiträumen möglich.

### **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die vom Teilfonds getätigten nachhaltigen Investitionen trugen unter anderem zu folgenden ökologischen Zielen bei:

1. Reduzierung von Treibhausgasemissionen und Verringerung des CO<sub>2</sub>-Fußabdrucks;
2. Übergang zu oder die Nutzung von erneuerbarer Energie.

Der Teilfonds bezog die Identifizierung und Analyse der ESG-Referenzen eines Unternehmens als integralen Bestandteil in den Anlageentscheidungsprozess ein, um die Bewertung von Risiken und potenziellen Renditen zu unterstützen. Zu den ESG-Referenzen zählten unter anderem:

- ökologische und soziale Faktoren, insbesondere die physischen Risiken des Klimawandels und des Personalmanagements, die potenziell erhebliche Auswirkungen auf die finanzielle Performance und die Bewertung eines Unternehmens haben.
- Corporate-Governance-Praktiken, die die Interessen von Minderheitsinvestoren schützten und eine langfristige nachhaltige Wertschöpfung förderten.

Der Teilfonds bezog die Identifizierung und Analyse der ESG-Referenzen eines Unternehmens als integralen Bestandteil in den Anlageentscheidungsprozess ein, um die Bewertung von Risiken und potenziellen Renditen zu unterstützen.

### **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Wir bestätigen, dass wir nachhaltige Vermögenswerte darauf geprüft haben, ob sie erhebliche Beeinträchtigungen verursachen können. Dies erfolgte im Rahmen des Standard-Anlageprozesses von HSBC Asset Management (HSBC) und unter Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen.

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?*

Der Anlageberater hat alle durch die Offenlegungsverordnung definierten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI) auf ihre Relevanz für den Teilfonds geprüft. Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren legt fest, wie HSBC die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen identifiziert und darauf reagiert, und in welcher Form HSBC Nachhaltigkeitsrisiken berücksichtigt, die sich negativ auf Wertpapiere auswirken können, in die der Teilfonds investiert. HSBC identifizierte in Zusammenarbeit mit externen Screening-Dienstleistern, wie Sustainalytics, ISS, MSCI und Trucost, Unternehmen und Regierungen mit schlechter Bilanz beim Management von ESG-Risiken, und wo solche wesentlichen Risiken identifiziert wurden, führte HSBC zusätzliche ESG-Due-Diligence-Prüfungen durch. Durch Screening identifizierte Nachhaltigkeitsauswirkungen einschließlich der PAI bildeten einen Schlüsselfaktor beim Anlageentscheidungsprozess.

Der oben beschriebene Ansatz führte dazu, dass unter anderem folgende Faktoren geprüft wurden:

- Engagement der Unternehmen für den Übergang zu CO<sub>2</sub>-armen Wirtschaften, zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern, Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus großen Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails; und
- Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit folgenden Bereichen: demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.

Die spezifischen PAI für diesen Teilfonds waren wie unten beschrieben.

Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren ist auf der Website [www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies](http://www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies) verfügbar.

## *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:*

HSBC hat sich der Anwendung und Förderung globaler Standards verpflichtet. Die wichtigsten Schwerpunktbereiche der Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren entsprachen den zehn UNGC-Grundsätzen. Diese Grundsätze stehen in Zusammenhang mit nicht finanziellen Risiken in den Bereichen Menschenrechte, Arbeit, Umweltschutz und Korruptionsbekämpfung. HSBC gehört darüber hinaus zu den Unterzeichnern der UN Principles for Responsible Investment. Diese bildeten den Rahmen für Ermittlung und Management von Nachhaltigkeitsrisiken beim Investmentansatz von HSBC. Von Unternehmen, in die der Teilfonds investierte, wurde erwartet, dass sie die Anforderungen des UNGC und der damit verbundenen Standards erfüllen.

Unternehmen, die belegbar gegen einen der zehn Grundsätze des UNGC verstießen, wurden systematisch ausgeschlossen. Der Teilfonds führte verstärkte Due-Diligence-Prüfungen bei Unternehmen durch, die als nicht konform mit den Prinzipien des UNGC angesehen wurden oder die nach den unternehmenseigenen ESG Ratings von HSBC als risikoreich angesehen wurden. Darüber hinaus wurden die Unternehmen nach internationalen Standards wie den OECD-Leitsätzen bewertet.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen. Hierbei gelten spezifische von der Union definierte Kriterien.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*



### **Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Der Teilfonds berücksichtigte die folgenden PAI, indem er sie als Nachhaltigkeitsindikatoren beobachtete:

- Treibhausgasemissionen (Scope 1 und Scope 2)
- CO<sub>2</sub>-Fußabdruck (Scope 1 und Scope 2)
- Treibhausgasintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1 und Scope 2)
- Verstöße gegen die UNGC- und OECD-Grundsätze; und
- Anteil der Investitionen mit Beteiligung an umstrittenen Waffen

Der Ansatz zur Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen beinhaltete unter anderem, dass HSBC das Engagement der Unternehmen für den Übergang zu kohlenstoffarmem Wirtschaften, die zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern sowie die Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette prüfte, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails. Ebenfalls berücksichtigt wurde das Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit den Bereichen demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung. Ausgeschlossen waren auch Unternehmen, deren Geschäftsaktivitäten als umweltschädlich eingestuft wurden.

Das Screening führte dazu, dass HSBC nicht in bestimmte Unternehmen und Emittenten investierte.





## Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der Investitionen** entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden: basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des Bezugszeitraums zum 31.03.2024

| Größte Investitionen                            | Sektor                         | % der Vermögenswerte Land |
|---|--------------------------------|---------------------------|
| Tencent Holdings Ltd.                           | Kommunikationsdienstleistungen | 9,53 % China              |
| Alibaba Group Holding Limited                   | Zyklische Konsumgüter          | 8,18 % China              |
| Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd.    | Informationstechnologie        | 5,85 % Taiwan             |
| Netease Inc                                     | Kommunikationsdienstleistungen | 4,99 % China              |
| China Construction Bank Corporation Class H     | Finanzen                       | 4,89 % China              |
| PDD Holdings Inc. Sponsored ADR Class A         | Zyklische Konsumgüter          | 4,80 % China              |
| Kweichow Moutai Co., Ltd. Class A               | Basiskonsumgüter               | 4,37 % China              |
| CNOOC Limited                                   | Energie                        | 3,44 % China              |
| New Oriental Education & Technology Group, Inc. | Zyklische Konsumgüter          | 3,32 % China              |
| China Telecom Corp. Ltd. Class H                | Kommunikationsdienstleistungen | 2,67 % China              |

Barmittel und Derivate wurden nicht berücksichtigt

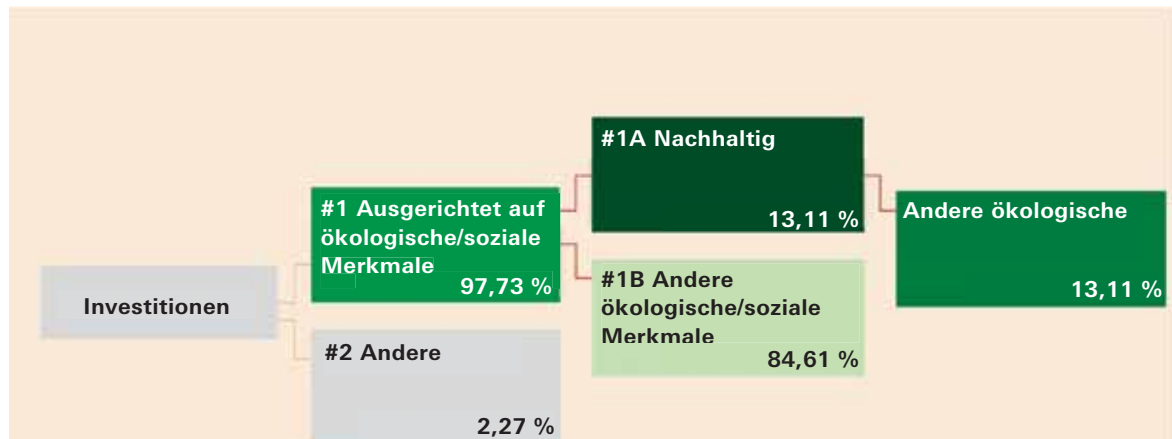


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

13,11 % des Portfolios waren in nachhaltige Vermögenswerte investiert.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.



**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**#2 Andere Investitionen** umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltig** 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?

| Sektor / Teilsektor                              | % der Vermögenswerte |
|--|----------------------|
| Zyklische Konsumgüter                            | 24,20 %              |
| Kommunikationsdienstleistungen                   | 22,15 %              |
| Finanzen   | 15,14 %              |
| Informationstechnologie                          | 11,91 %              |
| Industriegüter                                   | 6,86 %               |
| Basiskonsumgüter                                 | 5,49 %               |
| Gesundheitswesen                                 | 3,80 %               |
| Energie  | 3,38 %               |
| <i>Exploration und Produktion von Öl und Gas</i> | <i>3,38 %</i>        |
| Grundstoffe                                      | 2,18 %               |
| Immobilien                                       | 1,88 %               |
| Staatsanleihen                                   | 1,80 %               |
| Barmittel und Derivate                           | 0,56 %               |
| Versorger  | 0,46 %               |
| <i>Erdgas</i>                                    | <i>0,12 %</i>        |
| Andere   | 0,19 %               |
| Summe  | 100,00 %             |

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Kraftstoffe bis Ende 2035.

Die **Kriterien für Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



## Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

Der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen lag bei 0 %. Der Teilfonds hat sich nicht verpflichtet, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen.

### Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen.

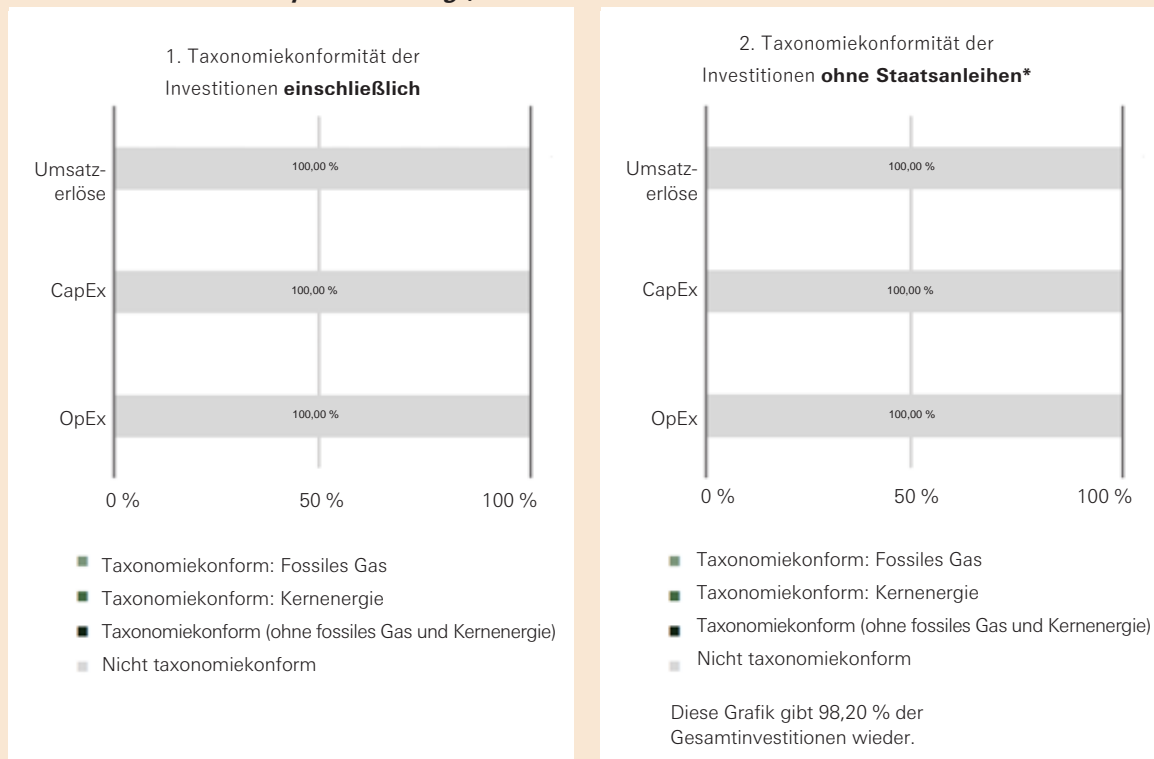
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

### Übergangstätigkeiten

sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

**Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonmiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.**



\* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

### Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Im Referenzzeitraum betrug der Anteil der Investitionen des Fonds, die in Übergangstätigkeiten geflossen sind, 0,00 % und der Anteil der Investitionen, die in ermöglichende Tätigkeiten geflossen ist, 0,00 %.

### Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

| Indikator   | 2023-2024 | 2022-2023 |
|---|-----------|-----------|
| Umsatz – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                       | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform: Kernenergie                        | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie) | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Nicht taxonomiekonform                               | 100,00 %  | 100,00 %  |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                        | n. z.     | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                         | n. z.     | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)  | n. z.     | 0,00 %    |
| CAPEX – Nicht taxonomiekonform                                | 100,00 %  | 100,00 %  |
| OPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                         | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                          | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)   | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Nicht taxonomiekonform                                 | 100,00 %  | 100,00 %  |

Da es sich erst um den zweiten Berichtszeitraum des Teilfonds handelt, ist ein Vergleich mit der Zeit davor nicht erforderlich.



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?**

Der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel war 13,11 %. Der Teilfonds hat sich nicht verpflichtet, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen.



### **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Teilfonds investierte nicht in sozial nachhaltige Anlagen.



### **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

#2 Andere Investitionen umfasst die Finanzinstrumente, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden. In manchen Fällen ist dies auf die Nichtverfügbarkeit von Daten und Unternehmensmaßnahmen zurückzuführen. Diese Positionen unterlagen nach wie vor dem vollständigen Ausschluss-Screening von HSBC und wurden im Hinblick auf verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Prinzipien des UNGC und der OECD geprüft.

Der Teilfonds hielt Barmittel / Barmitteläquivalente (der Prozentsatz der gehaltenen Barmittel ist in der obigen Tabelle der Sektoren/Teilsektoren unter der Überschrift „In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?“ ersichtlich) zum Zwecke des Liquiditätsmanagements sowie derivative Finanzinstrumente zum Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements. Barmittel / Barmitteläquivalente und derivative Finanzinstrumente verfügen aufgrund der Art dieser Instrumente über keinen ökologischen oder sozialen Mindestschutz.



### **Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?**

Im Laufe des Berichtszeitraums schloss der Anlageberater unter anderem verbotene Waffen, umstrittene Waffen, Unternehmen, die mehr als 10 % ihres Umsatzes aus Kraftwerkskohle und Energieerzeugung aus Kohle generieren, und Tabakherstellung aus und investierte in Unternehmen mit verantwortungsvollen Geschäftspraktiken gemäß den Prinzipien des UNGC.

Alle Positionen im Portfolio wurden hinsichtlich ihrer individuellen Kohlenstoffintensität untersucht, was zu einer Kohlenstoffintensität des Portfolios führte, die besser als die des Referenzwerts war. Der Teilfonds bewertete auch ESG-Scores mit dem Ergebnis, dass der ESG-Score während des gesamten Berichtszeitraums über dem des Referenzwerts lag.

Wurden außerdem wesentliche ESG-Risiken oder ein potenzieller Verstoß gegen einen oder mehrere der zehn Prinzipien des UNGC festgestellt, führte der Portfoliomanager/Analyst eine intensive Due-Diligence-Prüfung in Bezug auf ESG-Themen durch. Zudem war die Genehmigung des Investitionsausschusses erforderlich, bevor Investitionen getätigt werden konnten.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Nicht zutreffend.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Nicht zutreffend.

- **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?**

Nicht zutreffend.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

Name des Produkts: HSBC GLOBAL INVESTMENT FUNDS - EUROLAND EQUITY SMALLER COMPANIES

Unternehmenskennung (LEI-Code): 213800K2ESNFXN2ENI09

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

| ●● <input type="checkbox"/> Ja  | ●○ <input checked="" type="checkbox"/> Nein  |
|---|--|
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel</b> getätigt: _ % <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> </ul> | <input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit <b>ökologische/soziale Merkmale beworben</b> und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 39,74 % an nachhaltigen Investitionen <ul style="list-style-type: none"> <li><input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel</li> </ul> |
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel</b> getätigt: _ %   | <input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine <b>nachhaltigen Investitionen getätigt</b>  |

### Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Während des am 31. März 2024 endenden Geschäftsjahres (der Bezugszeitraum) hat der Teilfonds Folgendes beworben:

- Der Teilfonds prüfte und analysierte alle Unternehmen oder Emittenten im Hinblick auf ökologische Merkmale, insbesondere physische Risiken durch den Klimawandel und Personalmanagement. Für die zugrunde liegenden E-, S- und G-Säulen wurden ein Screening sowie ein Vergleich mit dem für den Teilfonds definierten Referenzwert durchgeführt. „E“ und „S“ spiegeln die einzelnen Elemente des vom Teilfonds beworbenen nachhaltigen Anlageziels wider, „G“ die

Unternehmensführungspraktiken, die die Interessen von Minderheitsaktionären schützen und langfristige nachhaltige Wertschöpfung fördern.

2. Der Teilfonds berücksichtigte verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Grundsätzen des Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC) und den Leitsätzen für multinationale Unternehmen der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für Unternehmen. Wurden potenzielle Verstöße gegen die Prinzipien des UNGC festgestellt, wurden die Emittenten einer eigenen Due-Diligence-Prüfung hinsichtlich ESG-Themen unterzogen, um festzustellen, ob sie für die Aufnahme in das Portfolio des Teilfonds geeignet sind, und sie auszuschließen, falls sie als ungeeignet erachtet wurden.

3. Der Teilfonds schloss als umweltschädlich eingestufte Geschäftsaktivitäten aus, wie Kraftwerkskohle und Energieerzeugung aus Kohle.

4. Der Teilfonds berücksichtigte aktiv ökologische und soziale Aspekte, indem er über unsere Engagement- und Stewardship-Teams Mitwirkung bei Emittenten umsetzte und sein Recht zur Stimmrechtsvertretung wahrnahm. 5. Der Teilfonds schloss Anlagen in umstrittenen Waffen aus.

Die ESG-Scores stammen vom externen ESG-Datenanbieter MSCI. Die Berücksichtigung einzelner (in der nachstehenden Tabelle nummerierter) wichtigster nachteiliger Auswirkungen (PAI) drückt sich darin aus, dass der Teilfonds niedrigere Werte als der Referenzwert aufweist. Die bei der Berechnung der PAI-Werte verwendeten Daten stammen von externen Datenanbietern. Sie können auf Unternehmensangaben basieren oder von den Datenanbietern geschätzt werden, wo keine solchen Angaben vorliegen. Bitte beachten Sie, dass es nicht immer möglich ist, die Richtigkeit, Aktualität oder Vollständigkeit der von Drittanbietern bereitgestellten Daten zu garantieren.

Der Teilfonds wurde aktiv verwaltet und bildete keinen Referenzwert nach. Der Referenzwert dient zum Vergleich des Teilfonds mit dem allgemeinen Markt, nicht jedoch der Erreichung der vom Teilfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale. Das Abschneiden der Nachhaltigkeitsindikatoren, die der Teilfonds zur Messung der Erreichung der von ihm beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet, ist in der folgenden Tabelle dargestellt. Es wurde auf das Erreichen eines ESG-Score des Teilfonds hingearbeitet, der über dem vom Teilfonds ausgewählten Referenzindex liegt (ein höherer Score als der Referenzwert bedeutet bessere ESG-Referenzen).

Alle Unternehmen haben eine gute Unternehmensführung bewiesen, was sich am PAI-Score 10 unten ablesen lässt.

### ● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

| Indikator  | Teilfonds | Referenzwert |
|--|-----------|--------------|
| ESG-Score  | 7,48      | 7,28         |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente pro Million Euro Umsatz   | 62,52     | 154,21       |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 0,00 %    | 0,00 %       |
| 13. Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen  | 39,93 %   | 39,54 %      |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 0,00 %    | 0,00 %       |

Die Daten in diesem regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung beziehen sich auf den Stand vom 31. März 2024, basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des am 31. März 2024 endenden Geschäftsjahres.

Referenzwert - MSCI EMU Small Mid

### ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

| Indikator  | Zeitraum zum  | Teilfonds | Referenzwert |
|--|---------------|-----------|--------------|
| ESG-Score  | 31. März 2024 | 7,48      | 7,28         |
|  | 31. März 2023 | 7,46      | 7,27         |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente pro Million Euro Umsatz   | 31. März 2024 | 62,52     | 154,21       |
|  | 31. März 2023 | 85,08     | 185,89       |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 31. März 2024 | 0,00 %    | 0,00 %       |
|  | 31. März 2023 | 0,00 %    | 0,00 %       |
| 13. Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen  | 31. März 2024 | 39,93 %   | 39,54 %      |
|  | 31. März 2023 | 39,60 %   | 39,31 %      |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 31. März 2024 | 0,00 %    | 0,00 %       |
|  | 31. März 2023 | 0,00 %    | 0,00 %       |

Da es sich erst um den zweiten regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung handelt, ist kein Vergleich mit vorangegangenen Zeiträumen möglich.

### Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Die vom Teilfonds getätigten nachhaltigen Investitionen trugen unter anderem zu folgenden ökologischen Zielen bei:

1. Reduzierung von Treibhausgasemissionen und Verringerung des CO<sub>2</sub>-Fußabdrucks;
2. Übergang zu oder die Nutzung von erneuerbarer Energie.

Der Teilfonds bezog die Identifizierung und Analyse der ESG-Referenzen eines Unternehmens als integralen Bestandteil in den Anlageentscheidungsprozess ein, um die Bewertung von Risiken und potenziellen Renditen zu unterstützen.

### Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Wir bestätigen, dass wir nachhaltige Vermögenswerte darauf geprüft haben, ob sie erhebliche Beeinträchtigungen verursachen können. Dies erfolgte im Rahmen des Standard-Anlageprozesses von HSBC Asset Management (HSBC) und unter Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen.

#### *Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?*

Der Anlageberater hat alle durch die Offenlegungsverordnung definierten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI) auf ihre Relevanz für den Teilfonds geprüft. Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren legt fest, wie HSBC die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen identifiziert und darauf reagiert, und in welcher Form HSBC Nachhaltigkeitsrisiken berücksichtigt, die sich negativ auf Wertpapiere auswirken können, in die der Teilfonds investiert. HSBC identifizierte in Zusammenarbeit mit externen Screening-Dienstleistern, wie Sustainalytics, ISS, MSCI und Trucost, Unternehmen und Regierungen mit schlechter Bilanz beim Management von ESG-Risiken, und wo solche wesentlichen Risiken identifiziert wurden, führte HSBC zusätzliche ESG-

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.



Due-Diligence-Prüfungen durch. Durch Screening identifizierte Nachhaltigkeitsauswirkungen einschließlich der PAI bildeten einen Schlüsselfaktor beim Anlageentscheidungsprozess.

Der oben beschriebene Ansatz führte dazu, dass unter anderem folgende Faktoren geprüft wurden:

- Engagement der Unternehmen für den Übergang zu CO<sub>2</sub>-armen Wirtschaften, zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern, Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus großen Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails; und
- Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit folgenden Bereichen: demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.

Die spezifischen PAI für diesen Teilfonds waren wie unten beschrieben.

Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren ist auf der Website [www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies](http://www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies) verfügbar.

*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:*

HSBC hat sich der Anwendung und Förderung globaler Standards verpflichtet. Die wichtigsten Schwerpunktbereiche der Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren entsprachen den zehn UNGC-Grundsätzen. Diese Grundsätze stehen in Zusammenhang mit nicht finanziellen Risiken in den Bereichen Menschenrechte, Arbeit, Umweltschutz und Korruptionsbekämpfung. HSBC gehört darüber hinaus zu den Unterzeichnern der UN Principles for Responsible Investment. Diese bildeten den Rahmen für Ermittlung und Management von Nachhaltigkeitsrisiken beim Investmentansatz von HSBC.

Von Unternehmen, in die der Teilfonds investierte, wurde erwartet, dass sie die Anforderungen des UNGC und der damit verbundenen Standards erfüllen. Unternehmen, die belegbar gegen einen der zehn Grundsätze des UNGC verstießen, wurden systematisch ausgeschlossen. Der Teilfonds führte verstärkte Due-Diligence-Prüfungen bei Unternehmen durch, die als nicht konform mit den Prinzipien des UNGC angesehen wurden oder die nach den unternehmenseigenen ESG Ratings von HSBC als risikoreich angesehen wurden. Darüber hinaus wurden die Unternehmen nach internationalen Standards wie den OECD-Leitsätzen bewertet.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen. Hierbei gelten spezifische von der Union definierte Kriterien.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*



### **Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Der Teilfonds berücksichtigte die folgenden PAI, indem er sie als Nachhaltigkeitsindikatoren beobachtete:

- Treibhausgasintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1 und Scope 2)
- Verstöße gegen die UNGC- und OECD-Grundsätze
- Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen
- Anteil der Investitionen mit Beteiligung an umstrittenen Waffen

Der Ansatz zur Berücksichtigung der PAI beinhaltete unter anderem, dass HSBC das Engagement der Unternehmen für den Übergang zu CO<sub>2</sub>-armen Wirtschaften, die zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern sowie die Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette prüfte, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails. Ebenfalls berücksichtigt wurde das Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit den Bereichen demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.

Das Screening führte dazu, dass HSBC nicht in bestimmte Unternehmen und Emittenten investierte.



## Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der Investitionen** entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden: basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des Bezugszeitraums zum 31.03.2024

| Größte Investitionen   | Sektor                         | % der Land Vermögenwerte              |
|------------------------|--------------------------------|---------------------------------------|
| ASM International N.V  | Informationstechnologie        | 3,95 % Niederlande                    |
| Symrise AG             | Grundstoffe                    | 3,68 % Deutschland                    |
| Euronext NV            | Finanzen                       | 3,39 % Niederlande                    |
| Brenntag SE            | Industriegüter                 | 3,31 % Deutschland                    |
| Eurofins Scientific SE | Gesundheitswesen               | 3,17 % Luxemburg                      |
| Kingspan Group Plc     | Industriegüter                 | 3,10 % Irland                         |
| FinecoBank SpA         | Finanzen                       | 2,96 % Italien                        |
| Tenaris S.A.           | Energie                        | 2,82 % Vereinigte Staaten von Amerika |
| Metso Corporation      | Industriegüter                 | 2,54 % Finnland                       |
| Sodexo SA              | Zyklische Konsumgüter          | 2,47 % Frankreich                     |
| Publicis Groupe SA     | Kommunikationsdienstleistungen | 2,45 % Frankreich                     |
| SPIE SA                | Industriegüter                 | 2,38 % Frankreich                     |
| Kesko Oyj Class B      | Basiskonsumgüter               | 2,29 % Finnland                       |
| ageas SA/NV            | Finanzen                       | 2,17 % Belgien                        |
| Wienerberger AG        | Grundstoffe                    | 2,13 % Österreich                     |

Barmittel und Derivate wurden nicht berücksichtigt

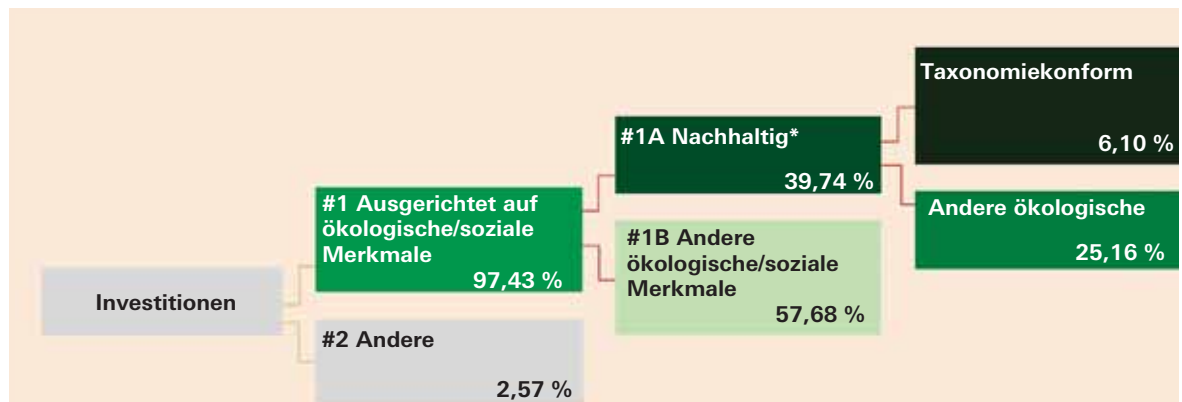


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

39,74 % des Portfolios waren in nachhaltige Vermögenswerte investiert.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?



**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**#2 Andere Investitionen** umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

\* Ein Unternehmen oder Emittent, das bzw. der als nachhaltige Investition angesehen wird, kann sowohl zu einem sozialen als auch zu einem ökologischen Ziel beitragen, das an der EU-Taxonomie ausgerichtet sein kann oder nicht. Die Zahlen in der obigen Grafik berücksichtigen dies. Jedoch darf eine Gesellschaft oder ein Emittent unter dem Punkt der nachhaltigen Investitionen (**#1A Nachhaltige Investitionen**) nur einmal erfasst werden.

Die Prozentzahlen von taxonomiekonformen Investitionen und Andere ökologische Merkmale stimmen aufgrund der unterschiedlichen Berechnungsmethoden für nachhaltige Investitionen und taxonomiekonforme Investitionen nicht mit **#1A Nachhaltige Investitionen** überein.

## In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

| Sektor / Teilsektor                                   | % der Vermögenswerte |
|---|----------------------|
| Industriegüter  | 24,97 %              |
| Finanzen  | 17,69 %              |
| Grundstoffe   | 10,85 %              |
| Kommunikationsdienstleistungen                        | 7,86 %               |
| Zyklische Konsumgüter                                 | 7,10 %               |
| Informationstechnologie                               | 6,85 %               |
| Gesundheitswesen                                      | 5,59 %               |
| Energie   | 5,57 %               |
| <i>Ausrüstung und Dienstleistungen für Öl und Gas</i> | <i>4,01 %</i>        |
| <i>Lagerung und Transport von Öl und Gas</i>          | <i>1,56 %</i>        |
| Versorger   | 4,55 %               |
| <i>Unabhängige Stromerzeuger und Energiehändler</i>   | <i>0,49 %</i>        |
| Basiskonsumgüter                                      | 3,79 %               |
| Immobilien  | 2,77 %               |
| Barmittel und Derivate                                | 2,41 %               |
| Summe   | 100,00 %             |

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Kraftstoffe bis Ende 2035.

Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.



## Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

Der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen ist in den obigen Feldern zur Vermögensallokation ersichtlich.

### Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonmiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonmiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonmiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

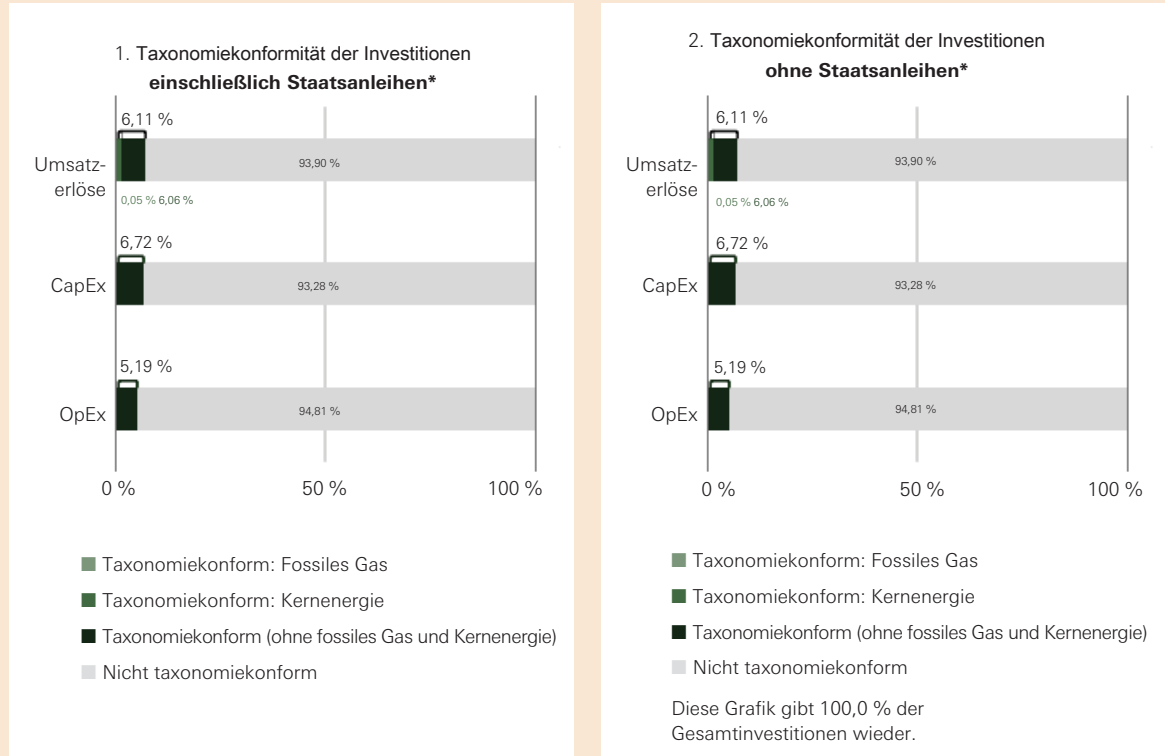
Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

**Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

**Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.**



\* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

**Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Im Referenzzeitraum betrug der Anteil der Investitionen des Fonds, die in Übergangstätigkeiten geflossen sind, 0,30 % und der Anteil der Investitionen, die in ermöglichende Tätigkeiten geflossen ist, 1,47 %.

**Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

| Indikator   | 2023-2024 | 2022-2023 |
|---|-----------|-----------|
| Umsatz – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                       | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform: Kernenergie                        | 0,05 %    | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie) | 6,06 %    | 0,00 %    |
| Umsatz – Nicht taxonomiekonform                               | 93,90 %   | 100,00 %  |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                        | n. z.     | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                         | n. z.     | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)  | 6,72 %    | 0,00 %    |
| CAPEX – Nicht taxonomiekonform                                | 93,28 %   | 100,00 %  |
| OPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                         | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                          | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)   | 5,19 %    | 0,00 %    |
| OPEX – Nicht taxonomiekonform                                 | 94,81 %   | 100,00 %  |

Da es sich erst um den zweiten Berichtszeitraum des Teilfonds handelt, ist ein Vergleich mit der Zeit davor nicht erforderlich.



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?**

Der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel war 25,16 %. Der Teilfonds hat sich nicht verpflichtet, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen.



### **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Teilfonds investierte nicht in sozial nachhaltige Anlagen.



### **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

#2 Andere Investitionen umfasst die Finanzinstrumente, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden. In manchen Fällen ist dies auf die Nichtverfügbarkeit von Daten und Unternehmensmaßnahmen zurückzuführen. Diese Positionen unterlagen nach wie vor dem vollständigen Ausschluss-Screening von HSBC und wurden im Hinblick auf verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Prinzipien des UNGC und der OECD geprüft.

Der Teilfonds hielt Barmittel / Barmitteläquivalente (der Prozentsatz der gehaltenen Barmittel ist in der obigen Tabelle der Sektoren/Teilektoren unter der Überschrift „In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?“ ersichtlich) zum Zwecke des Liquiditätsmanagements sowie derivative Finanzinstrumente zum Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements. Barmittel / Barmitteläquivalente und derivative Finanzinstrumente verfügen aufgrund der Art dieser Instrumente über keinen ökologischen oder sozialen Mindestschutz.



### **Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?**

Im Laufe des Berichtszeitraums schloss der Anlageberater unter anderem verbotene Waffen, umstrittene Waffen, Unternehmen, die mehr als 10 % ihres Umsatzes aus Kraftwerkskohle und Energieerzeugung aus Kohle generieren, und Tabakherstellung aus und investierte in Unternehmen mit verantwortungsvollen Geschäftspraktiken gemäß den Prinzipien des UNGC.

Die ESG-Analyse war in die Fundamentaldatenanalyse der Titel, in die der Anlageberater investierte, eingebettet und floss daher in alle Handelsgeschäfte ein. Die Handelsgeschäfte spiegelten eine ausgewogene Integration finanzieller und nichtfinanzieller Kriterien wider. Die bedeutendste Änderung war die Verringerung des Engagements in GTT, Laboratorios Farmaceuticos Rovi, Rai Way, deren Aktivitäten von Natur aus kohlenstoffintensiv sind. Aufgestockt wurden dagegen die Positionen in Publicis, Puma und UPM, deren Scores höher waren.

Wie oben beschrieben, bewertete der Teilfonds ESG-Scores mit dem Ergebnis, dass der ESG-Score während des gesamten Berichtszeitraums über dem des Referenzwerts lag. Der Anlageberater bewertete die Geschlechtervielfalt in den Unternehmensvorständen, was zu einem niedrigeren PAI-Score als der Referenzwert führte.



Darüber hinaus wurden alle Positionen auf Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der OECD untersucht, um Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung innerhalb des Portfolios sicherzustellen.

### Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Nicht zutreffend.

- **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?**

Nicht zutreffend.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen 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.

Name des Produkts: HSBC GLOBAL INVESTMENT FUNDS - EUROLAND GROWTH

Unternehmenskennung (LEI-Code): 213800UUVN3ZTID50892

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

| ●● <input type="checkbox"/> Ja  | ●○ <input checked="" type="checkbox"/> Nein  |
|---|--|
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel</b> getätigt: _ % <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> </ul> | <input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 56,13 % an nachhaltigen Investitionen <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel</li> </ul> |
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel</b> getätigt: _ %   | <input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine <b>nachhaltigen Investitionen getätigt</b>  |



### Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Während des am 31. März 2024 endenden Geschäftsjahres (der Bezugszeitraum) hat der Teilfonds Folgendes beworben:

- Der Teilfonds prüfte und analysierte alle Unternehmen oder Emittenten im Hinblick auf ökologische Merkmale, insbesondere physische Risiken durch den Klimawandel und Personalmanagement. Für die zugrunde liegenden E-, S- und G-Säulen wurden ein Screening sowie ein Vergleich mit dem für den Teilfonds definierten Referenzwert durchgeführt. „E“ und „S“ spiegeln die einzelnen Elemente des vom Teilfonds beworbenen nachhaltigen Anlageziels wider, „G“ die Unternehmensführungspraktiken, die die Interessen von Minderheitsaktionären schützen und langfristige nachhaltige Wertschöpfung fördern.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.



2. Der Teilfonds berücksichtigte verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Grundsätzen des Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC) und den Leitsätzen für multinationale Unternehmen der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für Unternehmen. Wurden potenzielle Verstöße gegen die Prinzipien des UNGC festgestellt, wurden die Emittenten einer eigenen Due-Diligence-Prüfung hinsichtlich ESG-Themen unterzogen, um festzustellen, ob sie für die Aufnahme in das Portfolio des Teilfonds geeignet sind, und sie auszuschließen, falls sie als ungeeignet erachtet wurden.
3. Der Teilfonds schloss Geschäftstätigkeiten aus, die als umweltschädlich gelten, wie z. B. die Förderung von Kraftwerkskohle und die Kohleverstromung.
4. Der Teilfonds berücksichtigte aktiv ökologische und soziale Aspekte, indem er über unsere Engagement- und Stewardship-Teams Mitwirkung bei Emittenten umsetzte und sein Recht zur Stimmrechtsvertretung wahrnahm.
5. Der Teilfonds schloss Anlagen in umstrittenen Waffen aus.

Die ESG-Scores stammen vom externen ESG-Datenanbieter MSCI. Die Berücksichtigung einzelner (in der nachstehenden Tabelle nummerierter) wichtigster nachteiliger Auswirkungen (PAI) drückt sich darin aus, dass der Teilfonds niedrigere Werte als der Referenzwert aufweist. Die bei der Berechnung der PAI-Werte verwendeten Daten stammen von externen Datenanbietern. Sie können auf Unternehmensangaben basieren oder von den Datenanbietern geschätzt werden, wo keine solchen Angaben vorliegen. Bitte beachten Sie, dass es nicht immer möglich ist, die Richtigkeit, Aktualität oder Vollständigkeit der von Drittanbietern bereitgestellten Daten zu garantieren.

Der Teilfonds wurde aktiv verwaltet und bildete keinen Referenzwert nach. Der Referenzwert dient zum Vergleich des Teilfonds mit dem allgemeinen Markt, nicht jedoch der Erreichung der vom Teilfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale. Das Abschneiden der Nachhaltigkeitsindikatoren, die der Teilfonds zur Messung der Erreichung der von ihm beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet, ist in der folgenden Tabelle dargestellt. Es wurde auf das Erreichen eines ESG-Score des Teilfonds hingearbeitet, der über dem vom Teilfonds ausgewählten Referenzindex liegt (ein höherer Score als der Referenzwert bedeutet bessere ESG-Referenzen).

Alle Unternehmen haben eine gute Unternehmensführung bewiesen, was sich am PAI-Score 10 unten ablesen lässt.

### **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

| <b>Indikator</b>   | <b>Teilfonds</b> | <b>Referenzwert</b> |
|--|------------------|---------------------|
| ESG-Score  | 8,44             | 7,81                |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente pro Million Euro Umsatz   | 85,95            | 109,50              |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 0,00 %           | 0,00 %              |
| 13. Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen  | 44,27 %          | 41,63 %             |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 0,00 %           | 0,00 %              |

Die Daten in diesem regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung beziehen sich auf den Stand vom 31. März 2024, basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des am 31. März 2024 endenden Geschäftsjahres.

Referenzwert – MSCI EMU

### ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

| Indikator  | Zeitraum zum  | Teilfonds | Referenzwert |
|--|---------------|-----------|--------------|
| ESG-Score  | 31. März 2024 | 8,44      | 7,81         |
|  | 31. März 2023 | 8,61      | 7,84         |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente pro Million Euro Umsatz   | 31. März 2024 | 85,95     | 109,50       |
|  | 31. März 2023 | 73,97     | 124,50       |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 31. März 2024 | 0,00 %    | 0,00 %       |
|  | 31. März 2023 | 0,00 %    | 0,00 %       |
| 13. Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen  | 31. März 2024 | 44,27 %   | 41,63 %      |
|  | 31. März 2023 | 43,65 %   | 41,34 %      |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 31. März 2024 | 0,00 %    | 0,00 %       |
|  | 31. März 2023 | 0,00 %    | 0,00 %       |

Da es sich erst um den zweiten regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung handelt, ist kein Vergleich mit vorangegangenen Zeiträumen möglich.

### Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Die vom Teilfonds getätigten nachhaltigen Investitionen trugen unter anderem zu folgenden ökologischen Zielen bei:

1. Reduzierung von Treibhausgasemissionen und Verringerung des CO<sub>2</sub>-Fußabdrucks;
2. Übergang zu oder die Nutzung von erneuerbarer Energie.

Der Teilfonds bezog die Identifizierung und Analyse der ESG-Referenzen eines Unternehmens als integralen Bestandteil in den Anlageentscheidungsprozess ein, um die Bewertung von Risiken und potenziellen Renditen zu unterstützen.

### Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Wir bestätigen, dass wir nachhaltige Vermögenswerte darauf geprüft haben, ob sie erhebliche Beeinträchtigungen verursachen können. Dies erfolgte im Rahmen des Standard-Anlageprozesses von HSBC Asset Management (HSBC) und unter Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen.

*Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?*

Der Anlageberater hat alle durch die Offenlegungsverordnung definierten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI) auf ihre Relevanz für den Teilfonds geprüft. Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren legt fest, wie HSBC die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen identifiziert und darauf reagiert, und in welcher Form HSBC Nachhaltigkeitsrisiken berücksichtigt, die sich negativ auf Wertpapiere auswirken können, in die der Teilfonds investiert. HSBC identifizierte in Zusammenarbeit mit externen Screening-Dienstleistern, wie Sustainalytics, ISS, MSCI und Trucost, Unternehmen und Regierungen mit schlechter Bilanz beim Management von ESG-Risiken, und wo solche wesentlichen Risiken identifiziert wurden, führte HSBC zusätzliche ESG-

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.

Due-Diligence-Prüfungen durch. Durch Screening identifizierte Nachhaltigkeitsauswirkungen einschließlich der PAI bildeten einen Schlüsselfaktor beim Anlageentscheidungsprozess.

Der oben beschriebene Ansatz führte dazu, dass unter anderem folgende Faktoren geprüft wurden:

- Engagement der Unternehmen für den Übergang zu CO<sub>2</sub>-armen Wirtschaften, zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern, Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus großen Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails; und
- Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit folgenden Bereichen: demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.

Die spezifischen PAI für diesen Teilfonds waren wie unten beschrieben.

Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren ist auf der Website [www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies](http://www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies) verfügbar.

*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:*

HSBC hat sich der Anwendung und Förderung globaler Standards verpflichtet. Die wichtigsten Schwerpunktbereiche der Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren entsprachen den zehn UNGC-Grundsätzen. Diese Grundsätze stehen in Zusammenhang mit nicht finanziellen Risiken in den Bereichen Menschenrechte, Arbeit, Umweltschutz und Korruptionsbekämpfung. HSBC gehört darüber hinaus zu den Unterzeichnern der UN Principles for Responsible Investment. Diese bildeten den Rahmen für Ermittlung und Management von Nachhaltigkeitsrisiken beim Investmentansatz von HSBC.

Von Unternehmen, in die der Teilfonds investierte, wurde erwartet, dass sie die Anforderungen des UNGC und der damit verbundenen Standards erfüllen. Unternehmen, die belegbar gegen einen der zehn Grundsätze des UNGC verstießen, wurden systematisch ausgeschlossen. Der Teilfonds führte verstärkte Due-Diligence-Prüfungen bei Unternehmen durch, die als nicht konform mit den Prinzipien des UNGC angesehen wurden oder die nach den unternehmenseigenen ESG Ratings von HSBC als risikoreich angesehen wurden. Darüber hinaus wurden die Unternehmen nach internationalen Standards wie den OECD-Leitsätzen bewertet.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen. Hierbei gelten spezifische von der Union definierte Kriterien.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*



### **Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Der Teilfonds berücksichtigte die folgenden PAI, indem er sie als Nachhaltigkeitsindikatoren beobachtete:

- Treibhausgasintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1 und Scope 2)
- Verstöße gegen die UNGC- und OECD-Grundsätze
- Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen
- Anteil der Investitionen mit Beteiligung an umstrittenen Waffen

Der Ansatz zur Berücksichtigung der PAI beinhaltete unter anderem, dass HSBC das Engagement der Unternehmen für den Übergang zu CO<sub>2</sub>-armen Wirtschaften, die zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern sowie die Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette prüfte, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails. Ebenfalls berücksichtigt wurde das Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit den Bereichen demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.

Das Screening führte dazu, dass HSBC nicht in bestimmte Unternehmen und Emittenten investierte.



## Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

| Größte Investitionen                | Sektor                         | % der Land Vermögenswerte             |
|-------------------------------------|--------------------------------|---------------------------------------|
| ASML Holding NV                     | Informationstechnologie        | 9,02 % Niederlande                    |
| LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE | Zyklische Konsumgüter          | 6,80 % Frankreich                     |
| SAP SE                              | Informationstechnologie        | 5,89 % Deutschland                    |
| Air Liquide SA                      | Grundstoffe                    | 4,94 % Frankreich                     |
| Schneider Electric SE               | Industriegüter                 | 4,59 % Vereinigte Staaten von Amerika |
| Hermes International SCA            | Zyklische Konsumgüter          | 4,53 % Frankreich                     |
| L'Oreal S.A.                        | Basiskonsumgüter               | 4,51 % Frankreich                     |
| Allianz SE                          | Finanzen                       | 4,42 % Deutschland                    |
| Wolters Kluwer N.V                  | Industriegüter                 | 3,26 % Niederlande                    |
| Deutsche Telekom AG                 | Kommunikationsdienstleistungen | 3,25 % Deutschland                    |

Barmittel und Derivate wurden nicht berücksichtigt

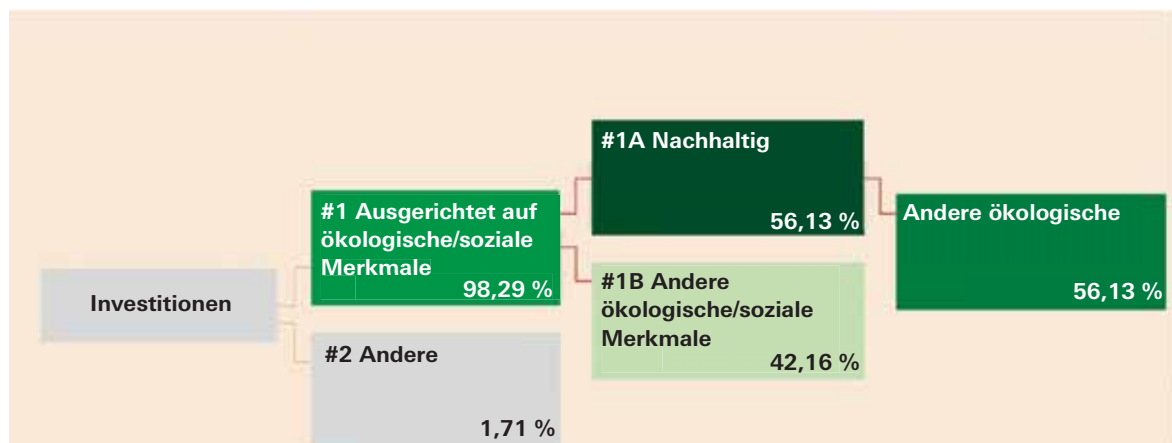
Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der Investitionen** entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden: basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des Bezugszeitraums zum 31.03.2024



## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

56,13 % des Portfolios waren in nachhaltige Vermögenswerte investiert.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?



**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**#2 Andere Investitionen** umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

## In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

| Sektor / Teilsektor                            | % der Vermögenswerte |
|--|----------------------|
| Informationstechnologie                        | 27,18 %              |
| Zyklische Konsumgüter                          | 16,49 %              |
| Industriegüter                                 | 16,23 %              |
| Finanzen                                       | 13,13 %              |
| Basiskonsumgüter                               | 9,64 %               |
| Grundstoffe                                    | 5,71 %               |
| Gesundheitswesen                               | 3,80 %               |
| Kommunikationsdienstleistungen                 | 3,12 %               |
| Energie  | 2,99 %               |
| <i>Integrierter Öl- und Gaskonzern</i>         | <i>0,58 %</i>        |
| <i>Raffination und Vertrieb von Öl und Gas</i> | <i>2,42 %</i>        |
| Barmittel und Derivate                         | 1,71 %               |
| Summe  | 100,00 %             |

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.



### Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

Der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen lag bei 0 %. Der Teilfonds hat sich nicht verpflichtet, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen.

### Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

Ja:
  In fossiles Gas
  In Kernenergie

Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen.

- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

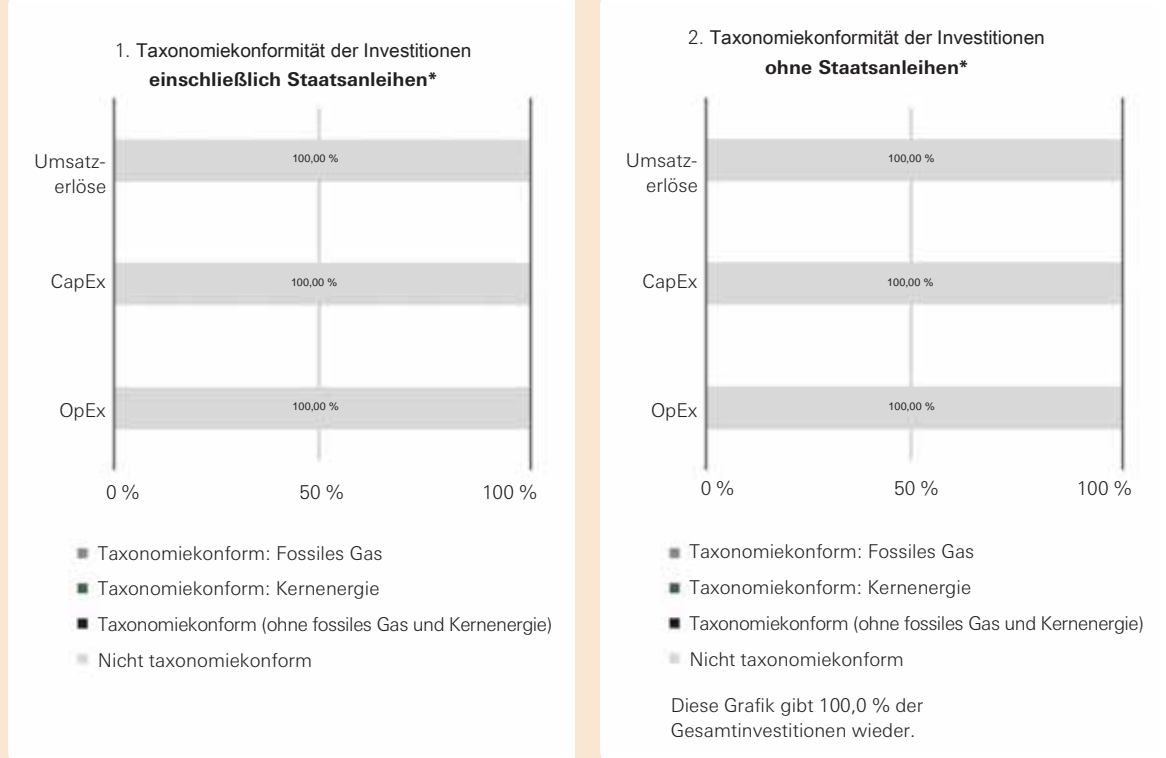
**Übergangstätigkeiten** sind

Tätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken

unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

**Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.**



\* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

**Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Im Referenzzeitraum betrug der Anteil der Investitionen des Fonds, die in Übergangstätigkeiten geflossen sind, 0,00 % und der Anteil der Investitionen, die in ermöglichende Tätigkeiten geflossen ist, 0,00 %.

**Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

| Indikator   | 2023-2024 | 2022-2023 |
|---|-----------|-----------|
| Umsatz – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                       | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform: Kernenergie                        | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie) | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Nicht taxonomiekonform                               | 100,00 %  | 100,00 %  |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                        | n. z.     | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                         | n. z.     | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)  | n. z.     | 0,00 %    |
| CAPEX – Nicht taxonomiekonform                                | 100,00 %  | 100,00 %  |
| OPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                         | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                          | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)   | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Nicht taxonomiekonform                                 | 100,00 %  | 100,00 %  |

Da es sich erst um den zweiten Berichtszeitraum des Teilfonds handelt, ist ein Vergleich mit der Zeit davor nicht erforderlich.



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?**

Der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel war 56,13 %. Der Teilfonds hat sich nicht verpflichtet, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen.



## **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Teilfonds investierte nicht in sozial nachhaltige Anlagen.



## **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

#2 Andere Investitionen umfasst die Finanzinstrumente, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden. In manchen Fällen ist dies auf die Nichtverfügbarkeit von Daten und Unternehmensmaßnahmen zurückzuführen. Diese Positionen unterlagen nach wie vor dem vollständigen Ausschluss-Screening von HSBC und wurden im Hinblick auf verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Prinzipien des UNGC und der OECD geprüft.

Der Teilfonds hielt Barmittel / Barmitteläquivalente (der Prozentsatz der gehaltenen Barmittel ist in der obigen Tabelle der Sektoren/Teilektoren unter der Überschrift „In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?“ ersichtlich) zum Zwecke des Liquiditätsmanagements sowie derivative Finanzinstrumente zum Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements. Barmittel / Barmitteläquivalente und derivative Finanzinstrumente verfügen aufgrund der Art dieser Instrumente über keinen ökologischen oder sozialen Mindestschutz.



## **Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?**

Im Laufe des Berichtszeitraums schloss der Anlageberater unter anderem verbotene Waffen, umstrittene Waffen, Unternehmen, die mehr als 10 % ihres Umsatzes aus Kraftwerkskohle und Energieerzeugung aus Kohle generieren, und Tabakherstellung aus und investierte in Unternehmen mit verantwortungsvollen Geschäftspraktiken gemäß den Prinzipien des UNGC.

Alle Positionen des Portfolios wurden hinsichtlich ihrer individuellen Treibhausgasintensität bewertet, was zu PAI-Scores führte, die im Einklang mit denen des Referenzwerts lagen. Der Teilfonds bewertete auch ESG-Scores mit dem Ergebnis, dass der ESG-Score während des gesamten Berichtszeitraums im Einklang mit dem des Referenzwerts lag.

Der Anlageberater bewertete die Geschlechtervielfalt in den Unternehmensvorständen, was zu einem etwas niedrigeren PAI-Score als der Referenzwert führte.

Darüber hinaus wurden alle Positionen auf Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der OECD untersucht, um Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung innerhalb des Portfolios sicherzustellen.





## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Nicht zutreffend.

- **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?**

Nicht zutreffend.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Name des Produkts: HSBC GLOBAL INVESTMENT FUNDS - EUROLAND VALUE

Unternehmenskennung (LEI-Code): 2138005UESNT8JGWI979

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

**Ja**

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: \_ %

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: \_ %

**Nein**

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 41,82 % an nachhaltigen Investitionen

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine **nachhaltigen Investitionen getätigt**



### Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Während des am 31. März 2024 endenden Geschäftsjahres (der Bezugszeitraum) hat der Teilfonds Folgendes beworben:

1. Der Teilfonds prüfte und analysierte alle Unternehmen oder Emittenten im Hinblick auf ökologische Merkmale, insbesondere physische Risiken durch den Klimawandel und Personalmanagement. Für die zugrunde liegenden E-, S- und G-Säulen wurden ein Screening sowie ein Vergleich mit dem für den Teilfonds definierten Referenzwert durchgeführt. „E“ und „S“ spiegeln die einzelnen Elemente des vom Teilfonds beworbenen nachhaltigen Anlageziels wider, „G“ die Unternehmensführungspraktiken, die die Interessen von Minderheitsaktionären schützen und langfristige nachhaltige Wertschöpfung fördern.

2. Der Teilfonds berücksichtigte verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Grundsätzen des Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC) und den Leitsätzen für multinationale Unternehmen der Organisation für wirtschaftliche

Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für Unternehmen. Wurden potenzielle Verstöße gegen die Prinzipien des UNGC festgestellt, wurden die Emittenten einer eigenen Due-Diligence-Prüfung hinsichtlich ESG-Themen unterzogen, um festzustellen, ob sie für die Aufnahme in das Portfolio des Teilfonds geeignet sind, und sie auszuschließen, falls sie als ungeeignet erachtet wurden.

3. Der Teilfonds schloss als umweltschädlich eingestufte Geschäftsaktivitäten aus, wie Kraftwerkskohle und Energieerzeugung aus Kohle.

4. Der Teilfonds berücksichtigte aktiv ökologische und soziale Aspekte, indem er über unsere Engagement- und Stewardship-Teams Mitwirkung bei Emittenten umsetzte und sein Recht zur Stimmrechtsvertretung wahrnahm.

5. Der Teilfonds schloss Anlagen in umstrittenen Waffen aus.

Die ESG-Scores stammen vom externen ESG-Datenanbieter MSCI. Die Berücksichtigung einzelner (in der nachstehenden Tabelle nummerierter) PAI drückt sich darin aus, dass der Teilfonds niedrigere Werte als der Referenzwert aufweist. Die bei der Berechnung der PAI-Werte verwendeten Daten stammen von externen Datenanbietern. Sie können auf Unternehmensangaben basieren oder von den Datenanbietern geschätzt werden, wo keine solchen Angaben vorliegen. Bitte beachten Sie, dass es nicht immer möglich ist, die Richtigkeit, Aktualität oder Vollständigkeit der von Drittanbietern bereitgestellten Daten zu garantieren.

Der Teilfonds wurde aktiv verwaltet und bildete keinen Referenzwert nach. Der Referenzwert dient zum Vergleich des Teilfonds mit dem allgemeinen Markt, nicht jedoch der Erreichung der vom Teilfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale. Das Abschneiden der Nachhaltigkeitsindikatoren, die der Teilfonds zur Messung der Erreichung der von ihm beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet, ist in der folgenden Tabelle dargestellt. Es wurde auf das Erreichen eines ESG-Score des Teilfonds hingearbeitet, der über dem vom Teilfonds ausgewählten Referenzindex liegt (ein höherer Score als der Referenzwert bedeutet bessere ESG-Referenzen).

Alle Unternehmen haben eine gute Unternehmensführung bewiesen, was sich am PAI-Score 10 unten ablesen lässt.

### ● *Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?*

| Indikator  | Teilfonds | Referenzwert |
|--|-----------|--------------|
| ESG-Score  | 7,91      | 7,81         |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente pro Million Euro Umsatz   | 130,31    | 109,50       |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 0,00 %    | 0,00 %       |
| 13. Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen  | 42,33 %   | 41,63 %      |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 0,00 %    | 0,00 %       |

Die Daten in diesem regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung beziehen sich auf den Stand vom 31. März 2024, basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des am 31. März 2024 endenden Geschäftsjahres.

Referenzwert – MSCI EMU

### ● *... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?*

| Indikator  | Zeitraum zum  | Teilfonds | Referenzwert |
|--|---------------|-----------|--------------|
| ESG-Score  | 31. März 2024 | 7,91      | 7,81         |
|  | 31. März 2023 | 7,90      | 7,84         |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente pro Million Euro Umsatz | 31. März 2024 | 130,31    | 109,50       |
|  | 31. März 2023 | 178,69    | 124,50       |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für  | 31. März 2024 | 0,00 %    | 0,00 %       |
|  | 31. März 2023 | 0,00 %    | 0,00 %       |

wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen

|  |               |         |         |
|--|---------------|---------|---------|
| 13. Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen  | 31. März 2024 | 42,33 % | 41,63 % |
|  | 31. März 2023 | 41,35 % | 41,34 % |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) | 31. März 2024 | 0,00 %  | 0,00 %  |
|  | 31. März 2023 | 0,00 %  | 0,00 %  |

Da es sich erst um den zweiten regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung handelt, ist kein Vergleich mit vorangegangenen Zeiträumen möglich.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die vom Teilfonds getätigten nachhaltigen Investitionen trugen unter anderem zu folgenden ökologischen Zielen bei:

1. Reduzierung von Treibhausgasemissionen
2. Übergang zu oder die Nutzung von erneuerbarer Energie.

Der Teilfonds bezog die Identifizierung und Analyse der ESG-Referenzen eines Unternehmens als integralen Bestandteil in den Anlageentscheidungsprozess ein, um die Bewertung von Risiken und potenziellen Renditen zu unterstützen.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Wir bestätigen, dass wir nachhaltige Vermögenswerte darauf geprüft haben, ob sie erhebliche Beeinträchtigungen verursachen können. Dies erfolgte im Rahmen des Standard-Anlageprozesses von HSBC Asset Management (HSBC) und unter Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen.

*Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?*

Der Anlageberater hat alle durch die Offenlegungsverordnung definierten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI) auf ihre Relevanz für den Teilfonds geprüft. Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren legt fest, wie HSBC die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen identifiziert und darauf reagiert, und in welcher Form HSBC Nachhaltigkeitsrisiken berücksichtigt, die sich negativ auf Wertpapiere auswirken können, in die der Teilfonds investiert. HSBC identifizierte in Zusammenarbeit mit externen Screening-Dienstleistern, wie Sustainalytics, ISS, MSCI und Trucost, Unternehmen und Regierungen mit schlechter Bilanz beim Management von ESG-Risiken, und wo solche wesentlichen Risiken identifiziert wurden, führte HSBC zusätzliche ESG-Due-Diligence-Prüfungen durch.

Durch Screening identifizierte Nachhaltigkeitsauswirkungen einschließlich der PAI bildeten einen Schlüsselfaktor beim Anlageentscheidungsprozess.

Der oben beschriebene Ansatz führte dazu, dass unter anderem folgende Faktoren geprüft wurden:

- Engagement der Unternehmen für den Übergang zu CO<sub>2</sub>-armen Wirtschaften, zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern, Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus großen Wert auf robuste Strukturen in den

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.

Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung

- strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails; und
- Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit folgenden Bereichen: demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.

Die spezifischen PAI für diesen Teilfonds waren wie unten beschrieben.

Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren ist auf der Website [www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies](http://www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies) verfügbar.

*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:*

HSBC hat sich der Anwendung und Förderung globaler Standards verpflichtet. Die wichtigsten Schwerpunktbereiche der Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren entsprachen den zehn UNGC-Grundsätzen. Diese Grundsätze stehen in Zusammenhang mit nicht finanziellen Risiken in den Bereichen Menschenrechte, Arbeit, Umweltschutz und Korruptionsbekämpfung. HSBC gehört darüber hinaus zu den Unterzeichnern der UN Principles for Responsible Investment. Diese bildeten den Rahmen für Ermittlung und Management von Nachhaltigkeitsrisiken beim Investmentansatz von HSBC. Von Unternehmen, in die der Teilfonds investierte, wurde erwartet, dass sie die Anforderungen des UNGC und der damit verbundenen Standards erfüllen. Unternehmen, die belegbar gegen einen der zehn Grundsätze des UNGC verstießen, wurden systematisch ausgeschlossen. Der Teilfonds führte verstärkte Due-Diligence-Prüfungen bei Unternehmen durch, die als nicht konform mit den Prinzipien des UNGC angesehen wurden oder die nach den unternehmenseigenen ESG Ratings von HSBC als risikoreich angesehen wurden. Darüber hinaus wurden die Unternehmen nach internationalen Standards wie den OECD-Leitsätzen bewertet.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen. Hierbei gelten spezifische von der Union definierte Kriterien.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*



## Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Teilfonds berücksichtigte die folgenden PAI, indem er sie als Nachhaltigkeitsindikatoren beobachtete:

- Treibhausgasintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1 und Scope 2)
- Verstöße gegen die UNGC- und OECD-Grundsätze
- Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen
- Anteil der Investitionen mit Beteiligung an umstrittenen Waffen

Der Ansatz zur Berücksichtigung der PAI beinhaltete unter anderem, dass HSBC das Engagement der Unternehmen für den Übergang zu CO<sub>2</sub>-armen Wirtschaften, die zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern sowie die Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette prüfte, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails. Ebenfalls berücksichtigt wurde das Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit den Bereichen demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.

Das Screening führte dazu, dass HSBC nicht in bestimmte Unternehmen und Emittenten investierte.



## Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** Investitionen entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden: basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des

| Größte Investitionen                            | Sektor NEU                     | % der Vermögenswerte | Land                           |
|---|--------------------------------|----------------------|--------------------------------|
| Allianz SE                                      | Finanzen                       | 4,46 %               | Deutschland                    |
| TotalEnergies SE                                | Energie                        | 3,97 %               | Frankreich                     |
| Iberdrola SA                                    | Versorger                      | 3,57 %               | Spanien                        |
| AXA SA  | Finanzen                       | 3,35 %               | Frankreich                     |
| ING Groep NV                                    | Finanzen                       | 2,87 %               | Niederlande                    |
| CRH public limited company                      | Grundstoffe                    | 2,78 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Cie Generale des Etablissements Michelin SA     | Zyklische Konsumgüter          | 2,75 %               | Frankreich                     |
| Siemens Aktiengesellschaft                      | Industriegüter                 | 2,65 %               | Deutschland                    |
| Sanofi  | Gesundheitswesen               | 2,63 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| ACS, Actividades de Construccion y Servicios SA | Industriegüter                 | 2,62 %               | Spanien                        |
| Koninklijke Ahold Delhaize N.V.                 | Basiskonsumgüter               | 2,57 %               | Niederlande                    |
| Merck KGaA                                      | Gesundheitswesen               | 2,56 %               | Deutschland                    |
| Royal KPN NV                                    | Kommunikationsdienstleistungen | 2,56 %               | Niederlande                    |
| Metso Corporation                               | Industriegüter                 | 2,46 %               | Finnland                       |
| ENGIE SA.                                       | Versorger                      | 2,45 %               | Frankreich                     |

Barmittel und Derivate wurden nicht berücksichtigt

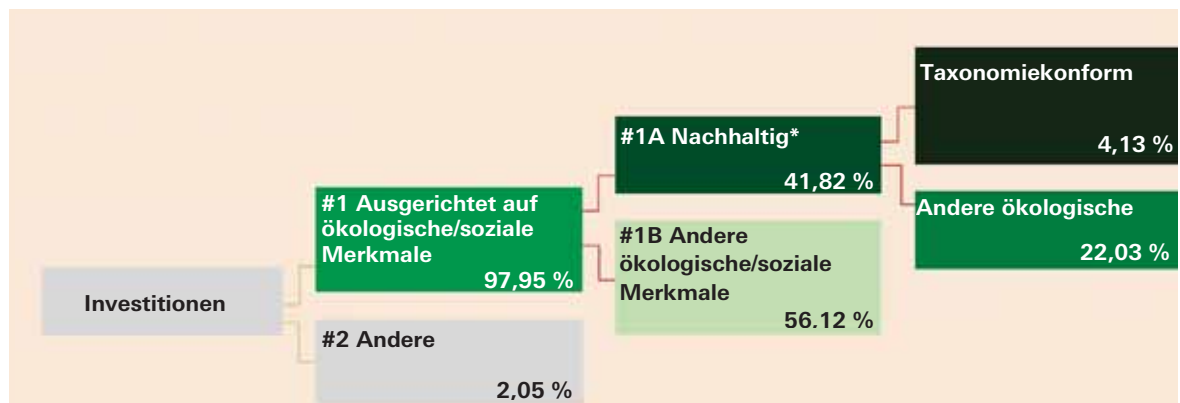


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

41,82 % des Portfolios waren in nachhaltige Vermögenswerte investiert.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?



**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**#2 Andere Investitionen** umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

\* Ein Unternehmen oder Emittent, das bzw. der als nachhaltige Investition angesehen wird, kann sowohl zu einem sozialen als auch zu einem ökologischen Ziel beitragen, das an der EU-Taxonomie ausgerichtet sein kann oder nicht. Die Zahlen in der obigen Grafik berücksichtigen dies. Jedoch darf eine Gesellschaft oder ein Emittent unter dem Punkt der nachhaltigen Investitionen (#1A Nachhaltige Investitionen) nur einmal erfasst werden.

Die Prozentzahlen von taxonomiekonformen Investitionen und Andere ökologische Merkmale stimmen aufgrund der unterschiedlichen Berechnungsmethoden für nachhaltige Investitionen und taxonomiekonforme Investitionen nicht mit #1A Nachhaltige Investitionen überein.

### In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

| Sektor / Teilsektor                    | % der Vermögenswerte |
|--|----------------------|
| Finanzen                               | 22,62 %              |
| Industriegüter                         | 20,17 %              |
| Energie                                | 8,99 %               |
| <i>Integrierter Öl- und Gaskonzern</i> | <i>8,99 %</i>        |
| Gesundheitswesen                       | 7,90 %               |
| Basiskonsumgüter                       | 7,40 %               |
| Versorger                              | 7,26 %               |
| <i>Stromversorgungsbetriebe</i>        | <i>3,56 %</i>        |
| <i>Multi-Versorger</i>                 | <i>3,70 %</i>        |
| Kommunikationsdienstleistungen         | 7,10 %               |
| Grundstoffe                            | 6,54 %               |
| Zyklische Konsumgüter                  | 6,40 %               |
| Informationstechnologie                | 2,08 %               |
| Barmittel und Derivate                 | 2,05 %               |
| Immobilien                             | 1,49 %               |
| Summe                                  | 100,00 %             |



## Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

Der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen ist in den obigen Feldern zur Vermögensallokation ersichtlich.

### Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

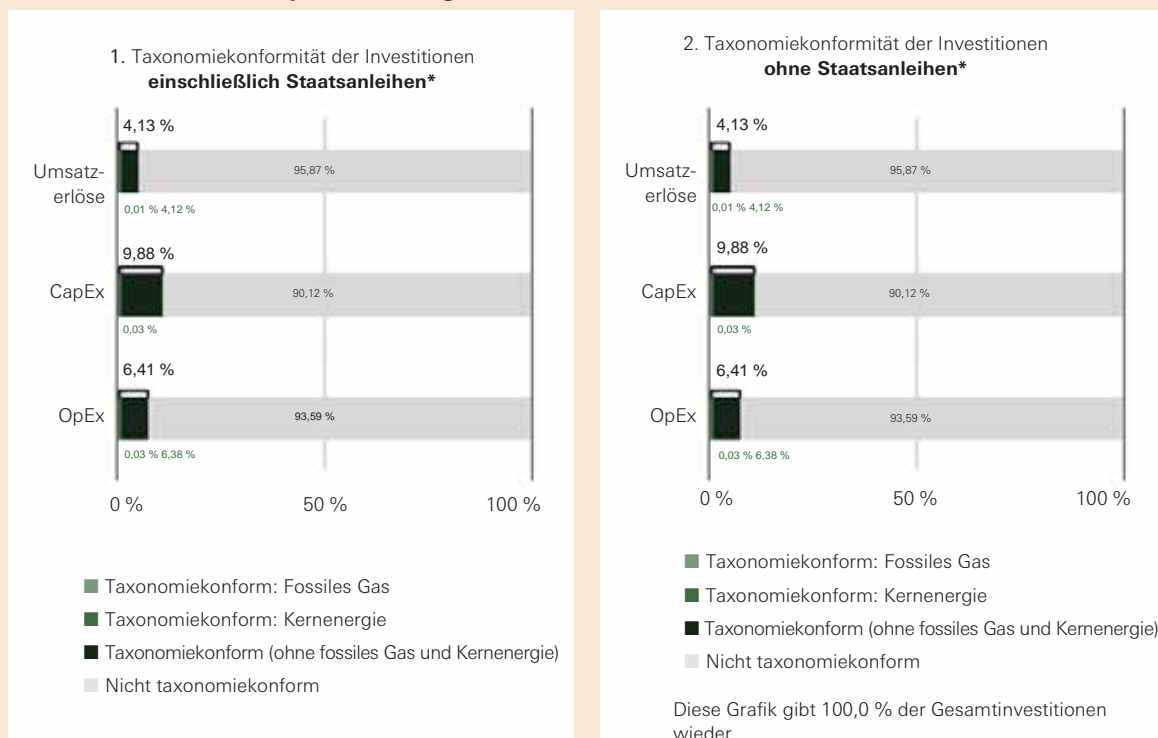
Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

*Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.*



\* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.



**Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.


● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Im Referenzzeitraum betrug der Anteil der Investitionen des Fonds, die in Übergangstätigkeiten geflossen sind, 0,35 % und der Anteil der Investitionen, die in ermöglichende Tätigkeiten geflossen ist, 2,49 %.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**


| Indikator   | 2023-2024 | 2022-2023 |
|---|-----------|-----------|
| Umsatz – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                       | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform: Kernenergie                        | 0,01 %    | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie) | 4,12 %    | 0,00 %    |
| Umsatz – Nicht taxonomiekonform                               | 95,87 %   | 100,00 %  |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                        | 0,00 %    | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                         | 0,03 %    | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)  | 9,85 %    | 0,00 %    |
| CAPEX – Nicht taxonomiekonform                                | 90,12 %   | 100,00 %  |
| OPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                         | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                          | 0,03 %    | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)   | 6,38 %    | 0,00 %    |
| OPEX – Nicht taxonomiekonform                                 | 93,59 %   | 100,00 %  |

Da es sich erst um den zweiten Berichtszeitraum des Teilfonds handelt, ist ein Vergleich mit der Zeit davor nicht erforderlich.

 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?**

Der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel war 22,03 %. Der Teilfonds hat sich nicht verpflichtet, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen.


 **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Teilfonds investierte nicht in sozial nachhaltige Anlagen.

 **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

#2 Andere Investitionen umfasst die Finanzinstrumente, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden. Grund dafür ist in einigen Fällen die Nichtverfügbarkeit von Daten und Unternehmensmaßnahmen. Diese Positionen unterlagen nach wie vor dem vollständigen Ausschluss-Screening von HSBC und wurden im Hinblick auf verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Prinzipien des UNGC und der OECD geprüft.

Der Teilfonds hielt Barmittel / Barmitteläquivalente (der Prozentsatz der gehaltenen Barmittel ist in der obigen Tabelle der Sektoren/Teilspektoren unter der Überschrift „In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?“ ersichtlich) zum Zwecke des Liquiditätsmanagements sowie derivative Finanzinstrumente zum Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements. Barmittel / Barmitteläquivalente und derivative Finanzinstrumente verfügen aufgrund der Art dieser Instrumente über keinen ökologischen oder sozialen Mindestschutz.

 **Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?**

Im Laufe des Berichtszeitraums schloss der Anlageberater unter anderem verbotene Waffen, umstrittene Waffen, Unternehmen, die mehr als 10 % ihres Umsatzes aus Kraftwerkskohle und Energieerzeugung aus Kohle generieren, und Tabakherstellung aus und investierte in Unternehmen mit verantwortungsvollen Geschäftspraktiken gemäß den Prinzipien des UNGC.

Die ESG-Analyse war in die Fundamentaldatenanalyse der Titel, in die der Anlageberater investierte, eingebettet und floss daher in alle Handelsgeschäfte ein. Die Handelsgeschäfte spiegelten eine ausgewogene Integration finanzieller und nichtfinanzieller Kriterien wider. Die bedeutendste Änderung war die Reduzierung des Engagements in ArcelorMittal, Arkema und Solvay, deren ESG-Scores relativ niedrig waren. Die Positionen in KPN, OMV, Iberdrola und Galp, deren Scores höher waren, wurden aufgestockt. Die Positionen in CRH, ArcelorMittal, Engie und Veolia, deren Tätigkeiten von Natur aus kohlenstoffintensiv sind, wurden reduziert. Im Gegensatz dazu wurden die Positionen in Siemens, Merck, Poste Italiane, Erste Group und KPN, deren Kohlenstoffemissionen als gering erachtet wurden, aufgestockt. Im Tagesgeschäft wandte der Anlageberater unsere Stewardship-Richtlinie an und suchte den Dialog mit den Unternehmen. Zudem wandte er auch die Abstimmungspolitik von HSBC an.

Wie oben beschrieben, bewertete der Teilfonds ESG-Scores mit dem Ergebnis, dass der ESG-Score während des gesamten Berichtszeitraums über dem des Referenzwerts lag. Der Anlageberater bewertete die Geschlechtervielfalt in den Unternehmensvorständen, was zu einem niedrigeren PAI-Score als der Referenzwert führte.

Darüber hinaus wurden alle Positionen auf Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der OECD untersucht, um Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung innerhalb des Portfolios sicherzustellen.



### **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

● ***Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?***

Nicht zutreffend.

● ***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?***

Nicht zutreffend.

● ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?***

Nicht zutreffend.

● ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?***

Nicht zutreffend.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen 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.

Name des Produkts: HSBC GLOBAL INVESTMENT FUNDS - EUROPE VALUE

Unternehmenskennung (LEI-Code): 213800NDHT1X7UMKBO83

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

**Ja**

- Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: \_ %
  - in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
  - in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: \_ %

**Nein**

- Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 36,44 % an nachhaltigen Investitionen
  - mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
  - mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
  - mit einem sozialen Ziel
- Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt**



### Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die von diesem Teilfonds beworbenen Merkmale waren:

1. Der Teilfonds prüfte und analysierte alle Unternehmen oder Emittenten im Hinblick auf ökologische Merkmale, insbesondere physische Risiken durch den Klimawandel und Personalmanagement. Für die zugrunde liegenden E-, S- und G-Säulen wurden ein Screening sowie ein Vergleich mit dem für den Teilfonds definierten Referenzwert durchgeführt. „E“ und „S“ spiegeln die einzelnen Elemente des vom Teilfonds beworbenen nachhaltigen Anlageziels wider, „G“ die Unternehmensführungspraktiken,

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

die die Interessen von Minderheitsaktionären schützen und langfristige nachhaltige Wertschöpfung fördern.

2. Der Teilfonds berücksichtigte verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Grundsätzen des Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC) und den Leitsätzen für multinationale Unternehmen der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für Unternehmen. Wurden potenzielle Verstöße gegen die Prinzipien des UNGC festgestellt, wurden die Emittenten einer eigenen Due-Diligence-Prüfung hinsichtlich ESG-Themen unterzogen, um festzustellen, ob sie für die Aufnahme in das Portfolio des Teilfonds geeignet sind, und sie auszuschließen, falls sie als ungeeignet erachtet wurden.

3. Der Teilfonds schloss Geschäftstätigkeiten aus, die als umweltschädlich gelten, wie z. B. die Förderung von Kraftwerkskohle und die Kohleverstromung.

4. Der Teilfonds berücksichtigte aktiv ökologische und soziale Aspekte, indem er über unsere Engagement- und Stewardship-Teams Mitwirkung bei Emittenten umsetzte und sein Recht zur Stimmrechtsvertretung wahrnahm.

5. Der Teilfonds schloss nach entsprechender Analyse Anlagen in umstrittenen Waffen aus. Die ESG-Scores stammen vom externen ESG-Datenanbieter MSCI. Die Berücksichtigung einzelner (in der nachstehenden Tabelle nummerierter) wichtigster nachteiliger Auswirkungen (PAI) drückt sich darin aus, dass der Teilfonds niedrigere Werte als der Referenzwert aufweist. Die bei der Berechnung der PAI-Werte verwendeten Daten stammen von externen Datenanbietern. Sie können auf Unternehmensangaben basieren oder von den Datenanbietern geschätzt werden, wo keine solchen Angaben vorliegen. Bitte beachten Sie, dass es nicht immer möglich ist, die Richtigkeit, Aktualität oder Vollständigkeit der von Drittanbietern bereitgestellten Daten zu garantieren.

Der Teilfonds wurde aktiv verwaltet und bildete keinen Referenzwert nach. Der Referenzwert dient zum Vergleich des Teilfonds mit dem allgemeinen Markt, nicht jedoch der Erreichung der vom Teilfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale. Das Abschneiden der Nachhaltigkeitsindikatoren, die der Teilfonds zur Messung der Erreichung der von ihm beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet, ist in der folgenden Tabelle dargestellt. Es wurde auf das Erreichen eines ESG-Score des Teilfonds hingearbeitet, der über dem vom Teilfonds ausgewählten Referenzindex liegt (ein höherer Score als der Referenzwert bedeutet bessere ESG-Referenzen).

Alle Unternehmen haben eine gute Unternehmensführung bewiesen, was sich am PAI-Score 10 unten ablesen lässt.

### **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

| <b>Indikator</b>   | <b>Teilfonds</b> | <b>Referenzwert</b> |
|--|------------------|---------------------|
| ESG-Score  | 7,97             | 7,82                |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente pro Million Euro Umsatz   | 135,27           | 98,22               |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 0,00 %           | 0,00 %              |
| 13. Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen  | 41,03 %          | 41,00 %             |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 0,00 %           | 0,40 %              |

Die Daten in diesem regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung beziehen sich auf den Stand vom 31. März 2024, basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des am 31. März 2024 endenden Geschäftsjahres.

Referenzwert – MSCI Europe

## ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

| Indikator  | Zeitraum zum  | Teilfonds | Referenzwert |
|--|---------------|-----------|--------------|
| ESG-Score  | 31. März 2024 | 7,97      | 7,82         |
|  | 31. März 2023 | 0,00      | 0,00         |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente pro Million Euro Umsatz   | 31. März 2024 | 135,27    | 98,22        |
|  | 31. März 2023 | 0,00      | 0,00         |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 31. März 2024 | 0,00 %    | 0,00 %       |
|  | 31. März 2023 | 0,00 %    | 0,00 %       |
| 13. Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen  | 31. März 2024 | 41,03 %   | 41,00 %      |
|  | 31. März 2023 | 0,00 %    | 0,00 %       |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 31. März 2024 | 0,00 %    | 0,40 %       |
|  | 31. März 2023 | 0,00 %    | 0,00 %       |

Da es sich erst um den zweiten regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung handelt, ist kein Vergleich mit vorangegangenen Zeiträumen möglich.

## Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Die vom Teilfonds getätigten nachhaltigen Investitionen trugen unter anderem zu folgenden ökologischen Zielen bei.

1. Reduzierung von Treibhausgasemissionen und Verringerung des CO<sub>2</sub>-Fußabdrucks;
2. Übergang zu oder die Nutzung von erneuerbarer Energie;

Der Teilfonds bezog die Identifizierung und Analyse der ESG-Referenzen eines Unternehmens als integralen Bestandteil in den Anlageentscheidungsprozess ein, um die Bewertung von Risiken und potenziellen Renditen zu unterstützen.

## Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Wir bestätigen, dass wir nachhaltige Vermögenswerte darauf geprüft haben, ob sie erhebliche Beeinträchtigungen verursachen können. Dies erfolgte im Rahmen des Standard-Anlageprozesses von HSBC Asset Management (HSBC) und unter Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen.

### Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageberater hat alle durch die Offenlegungsverordnung definierten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI) auf ihre Relevanz für den Teilfonds geprüft. Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren legt fest, wie HSBC die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen identifiziert und darauf reagiert, und in welcher Form HSBC Nachhaltigkeitsrisiken berücksichtigt, die sich negativ auf Wertpapiere auswirken können, in die der Teilfonds investiert. HSBC identifizierte in Zusammenarbeit mit externen Screening-Dienstleistern, wie Sustainalytics, ISS, MSCI und Trucost, Unternehmen und Regierungen mit schlechter Bilanz beim Management von ESG-Risiken, und wo

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.

solche wesentlichen Risiken identifiziert wurden, führte HSBC zusätzliche ESG-Due-Diligence-Prüfungen durch. Durch Screening identifizierte Nachhaltigkeitsauswirkungen einschließlich der PAI bildeten einen Schlüsselfaktor beim Anlageentscheidungsprozess.

Der oben beschriebene Ansatz führte dazu, dass unter anderem folgende Faktoren geprüft wurden:

- Engagement der Unternehmen für den Übergang zu CO2-armen Wirtschaften, zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern, Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus großen Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails; und
- Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit folgenden Bereichen: demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung. Die spezifischen wichtigsten nachteiligen Auswirkungen für diesen Teilfonds waren wie oben beschrieben.

Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren ist auf der Website [www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies](http://www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies) verfügbar.

*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:*

HSBC hat sich der Anwendung und Förderung globaler Standards verpflichtet. Die wichtigsten Schwerpunktbereiche der Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren entsprachen den zehn UNGC-Grundsätzen. Diese Grundsätze stehen in Zusammenhang mit nicht finanziellen Risiken in den Bereichen Menschenrechte, Arbeit, Umweltschutz und Korruptionsbekämpfung. HSBC gehört darüber hinaus zu den Unterzeichnern der UN Principles for Responsible Investment. Diese bildeten den Rahmen für Ermittlung und Management von Nachhaltigkeitsrisiken beim Investmentansatz von HSBC.

Von Unternehmen, in die der Teilfonds investierte, wurde erwartet, dass sie die Anforderungen des UNGC und der damit verbundenen Standards erfüllen. Unternehmen, die belegbar gegen einen der zehn Grundsätze des UNGC verstießen, wurden systematisch ausgeschlossen. Der Teilfonds führte verstärkte Due-Diligence-Prüfungen bei Unternehmen durch, die als nicht konform mit den Prinzipien des UNGC angesehen wurden oder die nach den unternehmenseigenen ESG Ratings von HSBC als risikoreich angesehen wurden. Darüber hinaus wurden die Unternehmen nach internationalen Standards wie den OECD-Leitsätzen bewertet.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen. Hierbei gelten spezifische von der Union definierte Kriterien.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*



## Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Teilfonds berücksichtigte die folgenden PAI, indem er sie als Nachhaltigkeitsindikatoren beobachtete:

- Treibhausgasintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1 und Scope 2)
- Verstöße gegen die UNGC- und OECD-Grundsätze
- Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen
- Anteil der Investitionen mit Beteiligung an umstrittenen Waffen

Der Ansatz zur Berücksichtigung der PAI beinhaltete unter anderem, dass HSBC das Engagement der Unternehmen für den Übergang zu CO<sub>2</sub>-armen Wirtschaften, die zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern sowie die Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette prüfte, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails. Ebenfalls berücksichtigt wurde das Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit den Bereichen demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung. Das Screening führte dazu, dass HSBC nicht in bestimmte Unternehmen und Emittenten investierte.



## Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

| Größte Investitionen        | Sektor           | % der Land Vermögenwerte | Land  |
|-----------------------------|------------------|--------------------------|---|
| AstraZeneca PLC             | Gesundheitswesen | 3,53 %                   | Vereinigtes Königreich von Großbritannien und Nordirland. |
| KBC Group N.V.              | Finanzen         | 3,42 %                   | Belgien   |
| ING Groep NV                | Finanzen         | 3,28 %                   | Niederlande   |
| Reckitt Benckiser Group pic | Basiskonsumgüter | 3,16 %                   | Vereinigtes Königreich von Großbritannien und Nordirland. |
| Commerzbank AG              | Finanzen         | 3,03 %                   | Deutschland   |

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** Investitionen entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden: basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des Bezugszeitraums zum 31.03.2024

|                            |                                |        |   |
|----------------------------|--------------------------------|--------|---|
| Novo Nordisk A/S Class B   | Gesundheitswesen               | 2,93 % | Dänemark  |
| BP p.l.c.                  | Energie                        | 2,72 % | Vereinigtes Königreich von Großbritannien und Nordirland. |
| Heineken NV                | Basiskonsumgüter               | 2,68 % | Niederlande   |
| Royal KPN NV               | Kommunikationsdienstleistungen | 2,62 % | Niederlande   |
| Allianz SE                 | Finanzen                       | 2,54 % | Deutschland   |
| Siemens Aktiengesellschaft | Industriegüter                 | 2,54 % | Deutschland   |
| Anheuser-Busch InBev SA/NV | Basiskonsumgüter               | 2,52 % | Belgien   |
| OMV AG                     | Energie                        | 2,45 % | Österreich  |
| UBS Group AG               | Finanzen                       | 2,45 % | Schweiz   |
| Novartis AG                | Gesundheitswesen               | 2,42 % | Schweiz   |

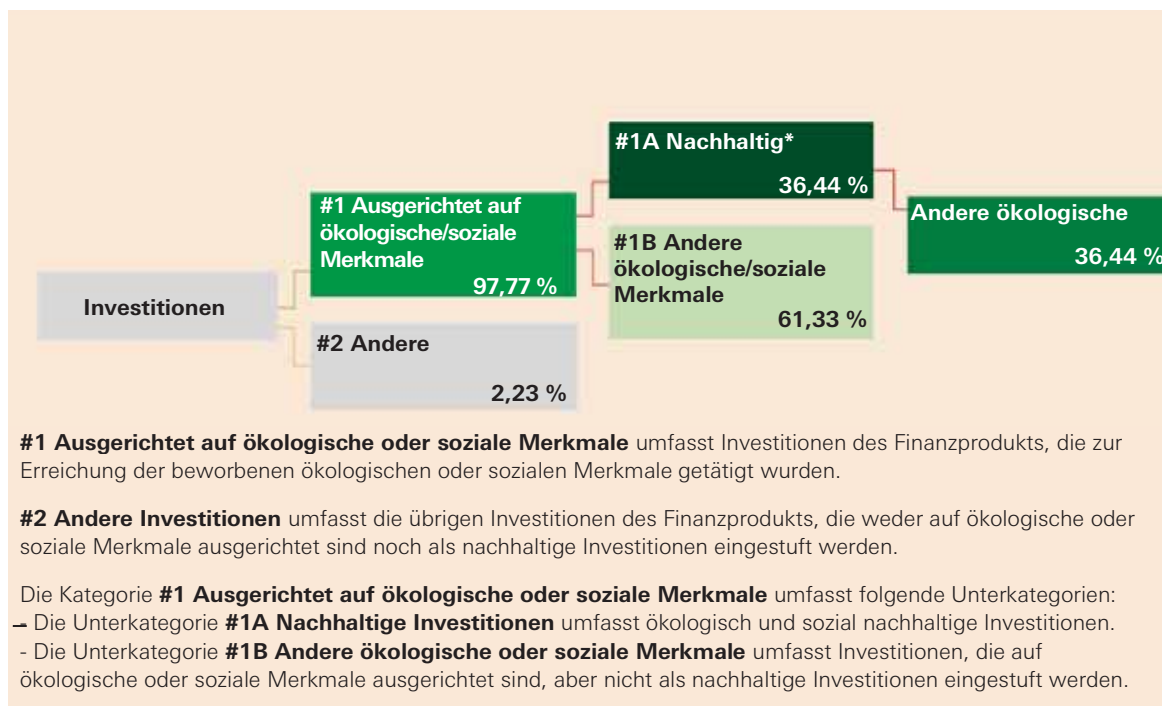
Barmittel und Derivate wurden nicht berücksichtigt



## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

36,44 % des Portfolios waren in nachhaltige Vermögenswerte investiert.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?



### In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

| Sektor / Teilsektor                    | % der Vermögenswerte |
|--|----------------------|
| Finanzen                               | 23,00 %              |
| Industriegüter                         | 17,16 %              |
| Grundstoffe                            | 11,74 %              |
| Gesundheitswesen                       | 10,09 %              |
| Basiskonsumgüter                       | 8,99 %               |
| Energie                                | 7,04 %               |
| <i>Integrierter Öl- und Gaskonzern</i> | <i>7,04 %</i>        |
| Kommunikationsdienstleistungen         | 6,23 %               |
| Zyklische Konsumgüter                  | 5,96 %               |



|                          |          |
|--------------------------|----------|
| Versorger                | 4,06 %   |
| Stromversorgungsbetriebe | 2,57 %   |
| Multi-Versorger          | 1,49 %   |
| Informationstechnologie  | 3,77 %   |
| Barmittel und Derivate   | 1,25 %   |
| Immobilien               | 0,70 %   |
| Summe                    | 100,00 % |

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO2-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



## Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

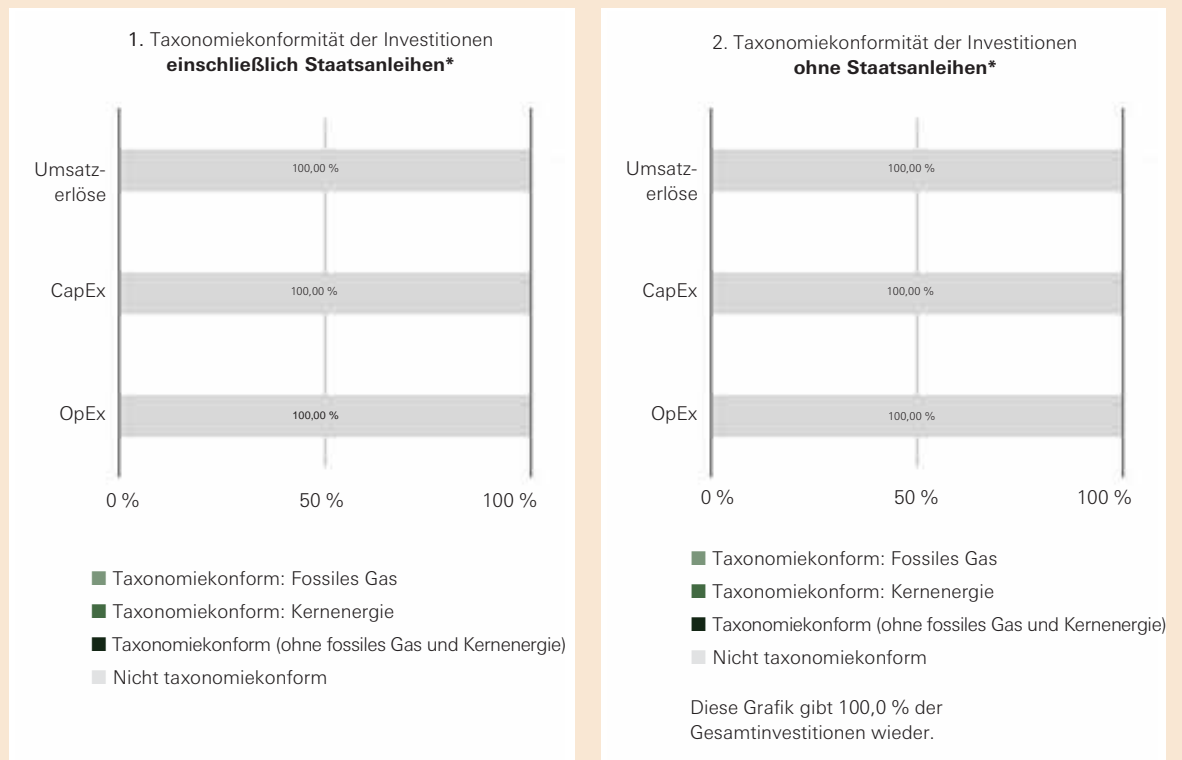
Der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen ist in den obigen Feldern zur Vermögensallokation ersichtlich.

### Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

Ja:
   
 In fossiles Gas
   
 In Kernenergie
   
 Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.


**Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.**



\* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen

**Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

 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?**

Im Referenzzeitraum betrug der Anteil der Investitionen des Fonds, die in Übergangstätigkeiten geflossen sind, 0,00 % und der Anteil der Investitionen, die in ermöglichende Tätigkeiten geflossen ist, 0,00 %.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

| Indikator   | 2023-2024 | 2022-2023 |
|---|-----------|-----------|
| Umsatz – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                       | n. z.     | n. z.     |
| Umsatz – Taxonomiekonform: Kernenergie                        | n. z.     | n. z.     |
| Umsatz – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie) | n. z.     | n. z.     |
| Umsatz – Nicht taxonomiekonform                               | 100,00 %  | n. z.     |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                        | n. z.     | n. z.     |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                         | n. z.     | n. z.     |
| CAPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)  | n. z.     | n. z.     |
| CAPEX – Nicht taxonomiekonform                                | 100,00 %  | n. z.     |
| OPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                         | n. z.     | n. z.     |
| OPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                          | n. z.     | n. z.     |
| OPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)   | n. z.     | n. z.     |
| OPEX – Nicht taxonomiekonform                                 | 100,00 %  | n. z.     |

Da es sich erst um den zweiten Berichtszeitraum des Teilfonds handelt, ist ein Vergleich mit der Zeit davor nicht erforderlich.

 **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel war 36,44 %. Der Teilfonds hat sich nicht verpflichtet, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen.

 **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Teilfonds investierte nicht in sozial nachhaltige Anlagen.

 **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

#2 Andere Investitionen umfasst die Finanzinstrumente, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden. In manchen Fällen ist dies auf die Nichtverfügbarkeit von Daten und Unternehmensmaßnahmen zurückzuführen. Diese Positionen unterlagen nach wie vor dem vollständigen Ausschluss-Screening von HSBC und wurden im Hinblick auf verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Prinzipien des UNGC und der OECD geprüft.

Der Teilfonds hielt Barmittel / Barmitteläquivalente (der Prozentsatz der gehaltenen Barmittel ist in der obigen Tabelle der Sektoren/Teilektoren unter der Überschrift „In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?“ ersichtlich) zum Zwecke des Liquiditätsmanagements sowie derivative Finanzinstrumente zum Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements. Barmittel / Barmitteläquivalente und derivative

Finanzinstrumente verfügen aufgrund der Art dieser Instrumente über keinen ökologischen oder sozialen Mindestschutz.



### **Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?**

Im Laufe des Berichtszeitraums schloss der Anlageberater unter anderem verbotene Waffen, umstrittene Waffen, Unternehmen, die mehr als 10 % ihres Umsatzes aus Kraftwerkskohle und Energieerzeugung aus Kohle generieren, und Tabakherstellung aus und investierte in Unternehmen mit verantwortungsvollen Geschäftspraktiken gemäß den Prinzipien des UNGC.

Der Teilfonds bewertete ESG-Scores mit dem Ergebnis, dass der ESG-Score während des gesamten Berichtszeitraums ähnlich dem des Referenzwerts war. Der Anlageberater bewertete die Geschlechtervielfalt in den Unternehmensvorständen, was zu einem etwas niedrigeren PAI-Score als der Referenzwert führte.

Darüber hinaus wurden alle Positionen auf Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der OECD untersucht, um Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung innerhalb des Portfolios sicherzustellen.



### **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

- ***Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?***

Nicht zutreffend.

- ***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?***

Nicht zutreffend.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?***

Nicht zutreffend.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?***

Nicht zutreffend.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen 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.

**Name des Produkts:** HSBC GLOBAL INVESTMENT FUNDS - GLOBAL EMERGING MARKETS EQUITY

**Unternehmenskennung (LEI-Code):** 213800LINXZ2GGCA7L71

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

| <input checked="" type="checkbox"/> <input type="checkbox"/> <b>Ja</b>   | <input type="checkbox"/> <input checked="" type="checkbox"/> <b>Nein</b>   |
|--|--|
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: _ % <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> </ul> | <input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 35,02 % an nachhaltigen Investitionen <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel</li> </ul> |
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel</b> getätigt: _ %  | <input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine <b>nachhaltigen Investitionen</b> getätigt  |



### Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Während des Geschäftsjahres zum 31. März 2024 (der Bezugszeitraum) bewarb der Teilfonds die folgenden Merkmale:

- Der Teilfonds prüfte und analysierte alle Unternehmen oder Emittenten im Hinblick auf ökologische Merkmale, insbesondere physische Risiken durch den Klimawandel und Personalmanagement. Für die zugrunde liegenden E-, S- und G-Säulen wurden ein Screening sowie ein Vergleich mit dem für den Teilfonds definierten Referenzwert durchgeführt. „E“ und „S“ spiegeln die einzelnen Elemente der vom Teilfonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale wider, „G“ die Unternehmensführungspraktiken, die die Interessen von Minderheitsaktionären schützen und eine langfristige nachhaltige Wertschöpfung fördern.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

2. Der Teilfonds berücksichtigte verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Grundsätzen des Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC) und den Leitsätzen für multinationale Unternehmen der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für Unternehmen.
3. Der Teilfonds schloss als umweltschädlich eingestufte Geschäftsaktivitäten aus, wie Kraftwerkskohle und Energieerzeugung aus Kohle.
4. Der Teilfonds berücksichtigte aktiv ökologische und soziale Aspekte, indem er über unsere Engagement- und Stewardship-Teams Mitwirkung bei Emittenten umsetzte und sein Recht zur Stimmrechtsvertretung wahrnahm.
5. Der Teilfonds schloss Anlagen in umstrittenen Waffen aus.

Der ESG-Score stammt vom externen ESG-Datenanbieter MSCI. Die Berücksichtigung einzelner (in der nachstehenden Tabelle nummerierter) wichtigster nachteiliger Auswirkungen (PAI) drückt sich darin aus, dass der Teilfonds niedrigere Werte als der Referenzwert aufweist. Die bei der Berechnung der PAI-Werte verwendeten Daten stammen von externen Datenanbietern. Sie können auf Unternehmensangaben basieren oder von den Datenanbietern geschätzt werden, wo keine solchen Angaben vorliegen. Bitte beachten Sie, dass es nicht immer möglich ist, die Richtigkeit, Aktualität oder Vollständigkeit der von Drittanbietern bereitgestellten Daten zu garantieren.

Der Teilfonds wurde aktiv verwaltet und bildete keinen Referenzwert nach. Der Referenzwert dient zum Vergleich des Teilfonds mit dem allgemeinen Markt, nicht jedoch der Erreichung der vom Teilfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale. Das Abschneiden der Nachhaltigkeitsindikatoren, die der Teilfonds zur Messung der Erreichung der von ihm beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet, ist in der folgenden Tabelle dargestellt.

Alle Unternehmen haben eine gute Unternehmensführung bewiesen, was sich am PAI-Score 10 unten ablesen lässt.

### ● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

| <b>Indikator</b>   | <b>Teilfonds</b> | <b>Referenzwert</b> |
|--|------------------|---------------------|
| ESG-Score  | 6,53             | 5,91                |
| E-Säule  | 6,70             | 5,83                |
| S-Säule  | 5,48             | 5,20                |
| G-Säule  | 4,97             | 4,69                |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente pro Million Euro Umsatz   | 165,60           | 384,37              |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 6,07 %           | 7,40 %              |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 0,00 %           | 0,00 %              |

Die Daten in diesem regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung beziehen sich auf den Stand vom 31. März 2024, basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des am 31. März 2024 endenden Geschäftsjahres.

Referenzwert – MSCI Emerging Markets

### **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

| <b>Indikator</b>   | <b>Zeitraum zum</b> | <b>Teilfonds</b> | <b>Referenzwert</b> |
|--|---------------------|------------------|---------------------|
| ESG-Score  | 31. März 2024       | 6,53             | 5,91                |
|  | 31. März 2023       | 6,02             | 5,85                |
| E-Säule  | 31. März 2024       | 6,70             | 5,83                |
|  | 31. März 2023       | 6,91             | 5,64                |
| S-Säule  | 31. März 2024       | 5,48             | 5,20                |
|  | 31. März 2023       | 5,56             | 5,30                |
| G-Säule  | 31. März 2024       | 4,97             | 4,69                |
|  | 31. März 2023       | 4,54             | 4,62                |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente pro Million Euro Umsatz   | 31. März 2024       | 165,60           | 384,37              |
|  | 31. März 2023       | 197,67           | 415,57              |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 31. März 2024       | 6,07 %           | 7,40 %              |
|  | 31. März 2023       | 11,13 %          | 4,19 %              |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 31. März 2024       | 0,00 %           | 0,00 %              |
|  | 31. März 2023       | 0,00 %           | 0,00 %              |

Da es sich erst um den zweiten regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung handelt, ist kein Vergleich mit vorangegangenen Zeiträumen möglich.

### **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die vom Teilfonds getätigten nachhaltigen Investitionen trugen unter anderem zu folgenden ökologischen Zielen bei:

1. Reduzierung von Treibhausgasemissionen und Verringerung des CO<sub>2</sub>-Fußabdrucks;
2. Übergang zu oder die Nutzung von erneuerbarer Energie.

Der Fonds bezieht die Identifizierung und Analyse der ESG-Referenzen eines Unternehmens als integralen Bestandteil in den Anlageentscheidungsprozess ein, um die Bewertung von Risiken und potenziellen Renditen zu unterstützen.

### **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Wir bestätigen, dass wir nachhaltige Vermögenswerte darauf geprüft haben, ob sie erhebliche Beeinträchtigungen verursachen können. Dies erfolgte im Rahmen des Standard-Anlageprozesses von HSBC Asset Management (HSBC) und unter Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen.

*Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?*

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 Anlageberater hat alle durch die Offenlegungsverordnung definierten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI) auf ihre Relevanz für den Teilfonds geprüft. Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren legt fest, wie HSBC die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen identifiziert und darauf reagiert, und in welcher Form HSBC Nachhaltigkeitsrisiken berücksichtigt, die sich negativ auf Wertpapiere auswirken können, in die der Teilfonds investiert. HSBC identifizierte in Zusammenarbeit mit externen Screening-Dienstleistern, wie Sustainalytics, ISS, MSCI und Trucost, Unternehmen und Regierungen mit schlechter Bilanz beim Management von ESG-Risiken, und wo solche wesentlichen Risiken identifiziert wurden, führte HSBC zusätzliche ESG-Due-Diligence-Prüfungen durch. Durch Screening identifizierte Nachhaltigkeitsauswirkungen einschließlich der PAI bildeten einen Schlüsselfaktor beim Anlageentscheidungsprozess.

Der oben beschriebene Ansatz führte dazu, dass unter anderem folgende Faktoren geprüft wurden:

- Engagement der Unternehmen für den Übergang zu CO<sub>2</sub>-armen Wirtschaften, zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern, Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus großen Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails; und
- Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit folgenden Bereichen: demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.

Die spezifischen PAI für diesen Teilfonds waren wie unten beschrieben.

Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren ist auf der Website [www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies](http://www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies) verfügbar.

*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:*

HSBC hat sich der Anwendung und Förderung globaler Standards verpflichtet. Die wichtigsten Schwerpunktbereiche der Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren entsprachen den zehn UNGC-Grundsätzen. Diese Grundsätze stehen in Zusammenhang mit nicht finanziellen Risiken in den Bereichen Menschenrechte, Arbeit, Umweltschutz und Korruptionsbekämpfung. HSBC gehört darüber hinaus zu den Unterzeichnern der UN Principles for Responsible Investment. Diese bildeten den Rahmen für Ermittlung und Management von Nachhaltigkeitsrisiken beim Investmentansatz von HSBC.

Von Unternehmen, in die der Teilfonds investierte, wurde erwartet, dass sie die Anforderungen des UNGC und der damit verbundenen Standards erfüllen. Unternehmen, die belegbar gegen einen der zehn Grundsätze des UNGC

verstießen, wurden systematisch ausgeschlossen. Der Teilfonds führte verstärkte Due-Diligence-Prüfungen bei Unternehmen durch, die als nicht konform mit den Prinzipien des UNGC angesehen wurden oder die nach den unternehmenseigenen ESG Ratings von HSBC als risikoreich angesehen wurden. Darüber hinaus wurden die Unternehmen nach internationalen Standards wie den OECD-Leitsätzen bewertet.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen. Hierbei gelten spezifische von der Union definierte Kriterien.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*



### **Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Der Teilfonds berücksichtigte die folgenden PAI, indem er sie als Nachhaltigkeitsindikatoren beobachtete:

- Treibhausgasintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1 und Scope 2)
- Verstöße gegen die UNGC- und OECD-Grundsätze
- Anteil der Investitionen mit Beteiligung an umstrittenen Waffen

Der Ansatz zur Berücksichtigung der PAI beinhaltete unter anderem, dass HSBC das Engagement der Unternehmen für den Übergang zu CO<sub>2</sub>-armen Wirtschaften, die zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern sowie die Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette prüfte, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails. Ebenfalls berücksichtigt wurde das Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit den Bereichen demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.

Das Screening führte dazu, dass HSBC nicht in bestimmte Unternehmen und Emittenten investierte.





## Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** Investitionen entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden: basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des Bezugszeitraums zum 31.03.2024

| Größte Investitionen                           | Sektor                         | % der Vermögenswerte | Land       |
|--|--------------------------------|----------------------|------------|
| Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd.   | Informationstechnologie        | 8,76 %               | Taiwan     |
| Samsung Electronics Co., Ltd.                  | Informationstechnologie        | 7,13 %               | Korea      |
| Reliance Industries Limited                    | Energie                        | 4,84 %               | Indien     |
| Alibaba Group Holding Limited                  | Zyklische Konsumgüter          | 4,31 %               | China      |
| Tencent Holdings Ltd.                          | Kommunikationsdienstleistungen | 4,09 %               | China      |
| Shriram Finance Limited                        | Finanzen                       | 3,42 %               | Indien     |
| PT Bank Rakyat Indonesia (Persero) Tbk Class B | Finanzen                       | 3,23 %               | Indonesien |
| Genera SAB de CV                               | Finanzen                       | 3,12 %               | Mexiko     |
| Hon Hai Precision Industry Co., Ltd.           | Informationstechnologie        | 2,85 %               | Taiwan     |
| Hyundai Motor Company                          | Zyklische Konsumgüter          | 2,73 %               | Korea      |
| MediaTek Inc                                   | Informationstechnologie        | 2,71 %               | Taiwan     |
| SK hynix Inc.                                  | Informationstechnologie        | 2,62 %               | Korea      |
| Meituan Class B                                | Zyklische Konsumgüter          | 2,48 %               | China      |

Barmittel und Derivate wurden nicht berücksichtigt

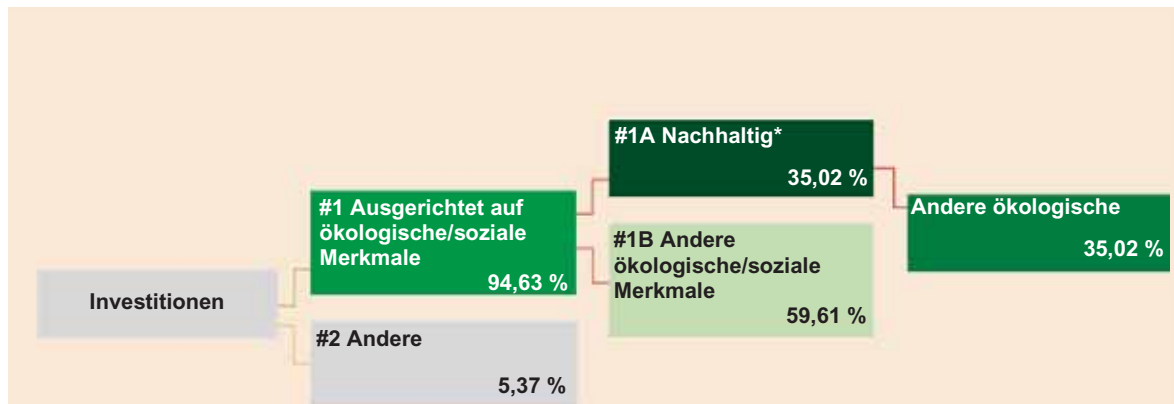


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

35,02 % des Portfolios waren in nachhaltige Vermögenswerte investiert.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?



**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**#2 Andere Investitionen** umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

## ● In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

| Sektor / Teilsektor                            | % der Vermögenswerte |
|--|----------------------|
| Informationstechnologie                        | 31,05 %              |
| Finanzen                                       | 21,14 %              |
| Kommunikationsdienstleistungen                 | 13,08 %              |
| Zyklische Konsumgüter                          | 11,44 %              |
| Industriegüter                                 | 7,31 %               |
| Energie  | 4,75 %               |
| <i>Raffination und Vertrieb von Öl und Gas</i> | <i>4,75 %</i>        |
| Versorger                                      | 2,90 %               |
| <i>Stromversorgungsbetriebe</i>                | <i>1,13 %</i>        |
| Grundstoffe                                    | 2,43 %               |
| Basiskonsumgüter                               | 2,21 %               |
| Barmittel und Derivate                         | 1,73 %               |
| Gesundheitswesen                               | 1,61 %               |
| Andere   | 0,34 %               |
| Summe  | 100,00 %             |

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der: **- Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



## Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

Der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen ist in den obigen Feldern zur Vermögensallokation ersichtlich.

### ● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

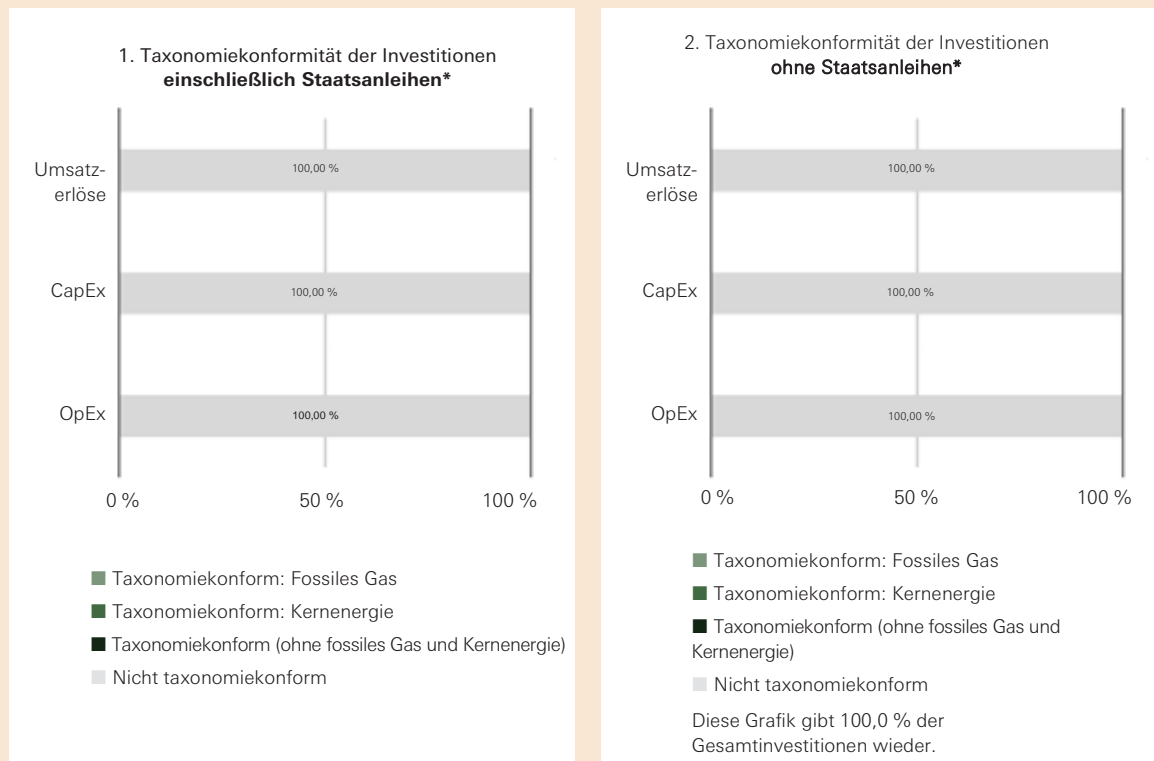
**- Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen.

**- Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

**Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

**Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonmiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.**



\* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

**Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Im Referenzzeitraum betrug der Anteil der Investitionen des Fonds, die in Übergangstätigkeiten geflossen sind, 0,00 % und der Anteil der Investitionen, die in ermöglichende Tätigkeiten geflossen ist, 0,00 %.

**Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

| Indikator   | 2023-2024 | 2022-2023 |
|---|-----------|-----------|
| Umsatz – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                       | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform: Kernenergie                        | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie) | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Nicht taxonomiekonform                               | 100,00 %  | 100,00 %  |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                        | n. z.     | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                         | n. z.     | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)  | n. z.     | 0,00 %    |
| CAPEX – Nicht taxonomiekonform                                | 100,00 %  | 100,00 %  |
| OPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                         | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                          | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)   | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Nicht taxonomiekonform                                 | 100,00 %  | 100,00 %  |

Da es sich erst um den zweiten Berichtszeitraum des Teilfonds handelt, ist ein Vergleich mit der Zeit davor nicht erforderlich.



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?**

Der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel war 35,02 %. Aufgrund der mangelnden Abdeckung und der fehlenden Daten hat sich der Teilfonds nicht verpflichtet, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen.



### **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Teilfonds investierte nicht in sozial nachhaltige Anlagen.



### **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

#2 Andere Investitionen umfasst die Finanzinstrumente, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden. In manchen Fällen ist dies auf die Nichtverfügbarkeit von Daten und Unternehmensmaßnahmen zurückzuführen. Diese Positionen unterlagen nach wie vor dem vollständigen Ausschluss-Screening von HSBC und wurden im Hinblick auf verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Prinzipien des UNGC und der OECD geprüft.

Der Teilfonds hielt Barmittel / Barmitteläquivalente (der Prozentsatz der gehaltenen Barmittel ist in der obigen Tabelle der Sektoren/Teilektoren unter der Überschrift „In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?“ ersichtlich) zum Zwecke des Liquiditätsmanagements sowie derivative Finanzinstrumente zum Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements. Barmittel / Barmitteläquivalente und derivative Finanzinstrumente verfügen aufgrund der Art dieser Instrumente über keinen ökologischen oder sozialen Mindestschutz.



### **Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?**

Im Laufe des Berichtszeitraums schloss der Anlageberater unter anderem verbotene Waffen, umstrittene Waffen, Unternehmen, die mehr als 10 % ihres Umsatzes aus Kraftwerkskohle und Energieerzeugung aus Kohle generieren, und Tabakherstellung aus und investierte in Unternehmen mit verantwortungsvollen Geschäftspraktiken gemäß den Prinzipien des UNGC.

Alle Positionen im Portfolio wurden hinsichtlich ihrer individuellen Kohlenstoffintensität untersucht, was zu einer Kohlenstoffintensität des Portfolios führte, die besser als die des Referenzwerts war. Der Teilfonds bewertete auch ESG-Scores mit dem Ergebnis, dass der ESG-Score während des gesamten Berichtszeitraums über dem des Referenzwerts lag.

Wurden außerdem wesentliche ESG-Risiken oder ein potenzieller Verstoß gegen einen oder mehrere der 10 Prinzipien des UNGC festgestellt, führte der Portfoliomanager/Analyst eine intensive Due-Diligence-Prüfung in Bezug auf ESG-Themen durch und holte die Genehmigung des Investitionsausschusses ein, bevor Investitionen getätigt werden konnten.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Nicht zutreffend.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Nicht zutreffend.

- **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?**

Nicht zutreffend.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

**Name des Produkts:** HSBC GLOBAL INVESTMENT FUNDS - GLOBAL EQUITY CLIMATE CHANGE

**Unternehmenskennung (LEI-Code):** 213800BN2PIFBP7BXW47

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

**Ja**

- Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: \_ %
  - in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
  - in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: \_ %

**Nein**

- Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 79,11 % an nachhaltigen Investitionen
  - mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
  - mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
  - mit einem sozialen Ziel
- Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine **nachhaltigen Investitionen getätigt**



### Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Während des am 31. März 2024 endenden Geschäftsjahres (der Bezugszeitraum) hat der Teilfonds Folgendes beworben:

1. Der Teilfonds investierte in Unternehmen, die den Übergang zu einer CO2-armen Wirtschaft unterstützten
2. Der Teilfonds berücksichtigte verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Grundsätzen des Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC) und den Leitsätzen für multinationale Unternehmen der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für Unternehmen. Wurden potenzielle

Verstöße gegen die Prinzipien des UNGC festgestellt, wurden die Unternehmen einer eigenen Due-Diligence-Prüfung hinsichtlich ESG-Themen unterzogen, um festzustellen, ob sie für die Aufnahme in das Portfolio des Teilfonds geeignet sind, und sie auszuschließen, falls sie als ungeeignet erachtet wurden.

3. Der Teilfonds schloss Geschäftstätigkeiten aus, die als umweltschädlich gelten, wie z. B. die Förderung von Kraftwerkskohle und die Kohleverstromung.

4. Der Teilfonds prüfte und analysierte alle Unternehmen im Hinblick auf ökologische Merkmale, insbesondere physische Risiken durch den Klimawandel und Personalmanagement. Für die zugrunde liegenden E-, S- und G-Säulen wurden ein Screening sowie ein Vergleich mit dem für den Teilfonds definierten Referenzwert durchgeführt. „E“ und „S“ spiegeln die einzelnen Elemente der vom Teilfonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale wider, „G“ die Unternehmensführungspraktiken, die die Interessen von Minderheitsaktionären schützen und eine langfristige nachhaltige Wertschöpfung fördern.

5. Der Teilfonds berücksichtigte aktiv ökologische und soziale Aspekte, indem er über unsere Engagement- und Stewardship-Teams Mitwirkung bei Emittenten umsetzte und sein Recht zur Stimmrechtsvertretung wahrnahm.

6. Der Teilfonds schloss nach entsprechender Analyse Anlagen in umstrittenen Waffen aus.

Die ESG-Scores stammen vom externen ESG-Datenanbieter MSCI. Die Berücksichtigung einzelner (in der nachstehenden Tabelle nummerierter) PAI drückt sich darin aus, dass der Teilfonds niedrigere Werte als der Referenzwert aufweist. Die bei der Berechnung der PAI-Werte verwendeten Daten stammen von externen Datenanbietern. Sie können auf Unternehmensangaben basieren oder von den Datenanbietern geschätzt werden wo keine solchen Angaben vorliegen. Bitte beachten Sie, dass es nicht immer möglich ist, die Richtigkeit, Aktualität oder Vollständigkeit der von Drittanbietern bereitgestellten Daten zu garantieren.

Der Teilfonds wurde aktiv verwaltet und bildete keinen Referenzwert nach. Der Referenzwert dient zum Vergleich des Teilfonds mit dem allgemeinen Markt, nicht jedoch der Erreichung der vom Teilfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale. Das Abschneiden der Nachhaltigkeitsindikatoren, die der Teilfonds zur Messung der Erreichung der von ihm beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet, ist in der folgenden Tabelle dargestellt. Es wurde auf das Erreichen eines ESG-Score des Teilfonds hingearbeitet, der über dem vom Teilfonds ausgewählten Referenzindex liegt (ein höherer Score als der Referenzwert bedeutet bessere ESG-Referenzen).

Alle Unternehmen haben eine gute Unternehmensführung bewiesen, was sich am PAI-Score 10 unten ablesen lässt.

### **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

| <b>Indikator</b>   | <b>Teilfonds</b> | <b>Referenzwert</b> |
|--|------------------|---------------------|
| ESG-Score  | 8,10             | 6,78                |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente pro Million Euro Umsatz   | 62,14            | 137,11              |
| 4. Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind   | 3,03 %           | 7,20 %              |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 0,00 %           | 1,39 %              |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 0,00 %           | 0,22 %              |

Die Daten in diesem regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung beziehen sich auf den

Stand vom 31. März 2024, basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des am 31. März 2024 endenden Geschäftsjahres.

Referenzwert – MSCI All Country World

### **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

| Indikator  | Zeitraum zum  | Teilfonds | Referenzwert |
|--|---------------|-----------|--------------|
| ESG-Score  | 31. März 2024 | 8,10      | 6,78         |
|  | 31. März 2023 | 8,32      | 6,82         |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente pro Million Euro Umsatz   | 31. März 2024 | 62,14     | 137,11       |
|  | 31. März 2023 | 83,75     | 167,71       |
| 4. Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind   | 31. März 2024 | 3,03 %    | 7,20 %       |
|  | 31. März 2023 | 3,64 %    | 7,62 %       |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 31. März 2024 | 0,00 %    | 1,39 %       |
|  | 31. März 2023 | 0,00 %    | 1,65 %       |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 31. März 2024 | 0,00 %    | 0,22 %       |
|  | 31. März 2023 | 0,00 %    | 0,00 %       |

Da es sich erst um den zweiten regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung handelt, ist kein Vergleich mit vorangegangenen Zeiträumen möglich.

### **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die vom Teilfonds getätigten nachhaltigen Investitionen trugen unter anderem zu folgenden ökologischen Zielen bei:

1. Reduzierung von Treibhausgasemissionen und Verringerung des CO<sub>2</sub>-Fußabdrucks;
2. Übergang zu oder die Nutzung von erneuerbarer Energie.

Der Teilfonds strebte bezogen auf den gewichteten Durchschnitt eine geringere CO<sub>2</sub>-Intensität und ein höheres ESG-Rating (Environmental, Social and Governance – Umwelt, Soziales und Unternehmensführung) an als die Bestandteile des Referenzwerts.

### **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Wir bestätigen, dass wir nachhaltige Vermögenswerte darauf geprüft haben, ob sie erhebliche Beeinträchtigungen verursachen können. Dies erfolgte im Rahmen des Standard-Anlageprozesses von HSBC Asset Management (HSBC) und unter Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen.

*Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?*

Der Anlageberater hat alle durch die Offenlegungsverordnung definierten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI) auf ihre Relevanz für den Teilfonds geprüft. Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren legt fest, wie HSBC die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen identifiziert und

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.



darauf reagiert, und in welcher Form HSBC Nachhaltigkeitsrisiken berücksichtigt, die sich negativ auf Wertpapiere auswirken können, in die der Teilfonds investiert. HSBC identifizierte in Zusammenarbeit mit externen Screening-Dienstleistern, wie Sustainalytics, ISS, MSCI und Trucost, Unternehmen und Regierungen mit schlechter Bilanz beim Management von ESG-Risiken, und wo solche wesentlichen Risiken identifiziert wurden, führte HSBC zusätzliche ESG-Due-Diligence-Prüfungen durch. Durch Screening identifizierte Nachhaltigkeitsauswirkungen einschließlich der PAI bildeten einen Schlüsselfaktor beim Anlageentscheidungsprozess.

Der oben beschriebene Ansatz führte dazu, dass unter anderem folgende Faktoren geprüft wurden:

- Engagement der Unternehmen für den Übergang zu CO<sub>2</sub>-armen Wirtschaften, zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern, Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus großen Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails; und
- Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit folgenden Bereichen: demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.

Die spezifischen PAI für diesen Teilfonds waren wie unten beschrieben.

Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren ist auf der Website [www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies](http://www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies) verfügbar.

*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:*

HSBC hat sich der Anwendung und Förderung globaler Standards verpflichtet. Die wichtigsten Schwerpunktbereiche der Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren entsprachen den zehn UNGC-Grundsätzen. Diese Grundsätze stehen in Zusammenhang mit nicht finanziellen Risiken in den Bereichen Menschenrechte, Arbeit, Umweltschutz und Korruptionsbekämpfung. HSBC gehört darüber hinaus zu den Unterzeichnern der UN Principles for Responsible Investment. Diese bildeten den Rahmen für Ermittlung und Management von Nachhaltigkeitsrisiken beim Investmentansatz von HSBC. Von Unternehmen, in die der Teilfonds investierte, wurde erwartet, dass sie die Anforderungen des UNGC und der damit verbundenen Standards erfüllen. Unternehmen, die belegbar gegen einen der zehn Grundsätze des UNGC verstießen, wurden systematisch ausgeschlossen. Der Teilfonds führte verstärkte Due-Diligence-Prüfungen bei Unternehmen durch, die als nicht konform mit den Prinzipien des UNGC angesehen wurden oder die nach den unternehmenseigenen ESG Ratings von HSBC als risikoreich angesehen wurden. Darüber hinaus wurden die Unternehmen nach internationalen Standards wie den OECD-Leitsätzen bewertet.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen. Hierbei gelten spezifische von der Union definierte Kriterien.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*



### **Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Der Teilfonds berücksichtigte die folgenden PAI, indem er sie als Nachhaltigkeitsindikatoren beobachtete:

- Treibhausgasintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1 und Scope 2)
- Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
- Verstöße gegen die UNGC- und OECD-Grundsätze
- Anteil der Investitionen mit Beteiligung an umstrittenen Waffen

Der Ansatz zur Berücksichtigung der PAI beinhaltete unter anderem, dass HSBC das Engagement der Unternehmen für den Übergang zu CO<sub>2</sub>-armen Wirtschaften, die zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern sowie die Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette prüfte, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails. Ebenfalls berücksichtigt wurde das Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit den Bereichen demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.

Das Screening führte dazu, dass HSBC nicht in bestimmte Unternehmen und Emittenten investierte.



## Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** Investitionen entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden: basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des Bezugszeitraums zum 31.03.2024

| Größte Investitionen                    | Sektor                  | % der Vermögenswerte | Land                           |
|---|-------------------------|----------------------|--------------------------------|
| Trane Technologies pic                  | Industriegüter          | 4,96 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Schneider Electric SE                   | Industriegüter          | 4,84 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Prysmian S.p.A.                         | Industriegüter          | 4,72 %               | Italien                        |
| Microsoft Corporation                   | Informationstechnologie | 4,66 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Ecolab Inc.                             | Grundstoffe             | 4,57 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Accenture Plc Class A                   | Informationstechnologie | 4,40 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Autodesk, Inc.                          | Informationstechnologie | 4,32 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Verisk Analytics Inc                    | Industriegüter          | 4,23 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Infineon Technologies AG                | Informationstechnologie | 3,81 %               | Deutschland                    |
| Watts Water Technologies, Inc. Klasse A | Industriegüter          | 3,78 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Hubbell Incorporated                    | Industriegüter          | 3,12 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Capgemini SE                            | Informationstechnologie | 3,05 %               | Frankreich                     |

Barmittel und Derivate wurden nicht berücksichtigt

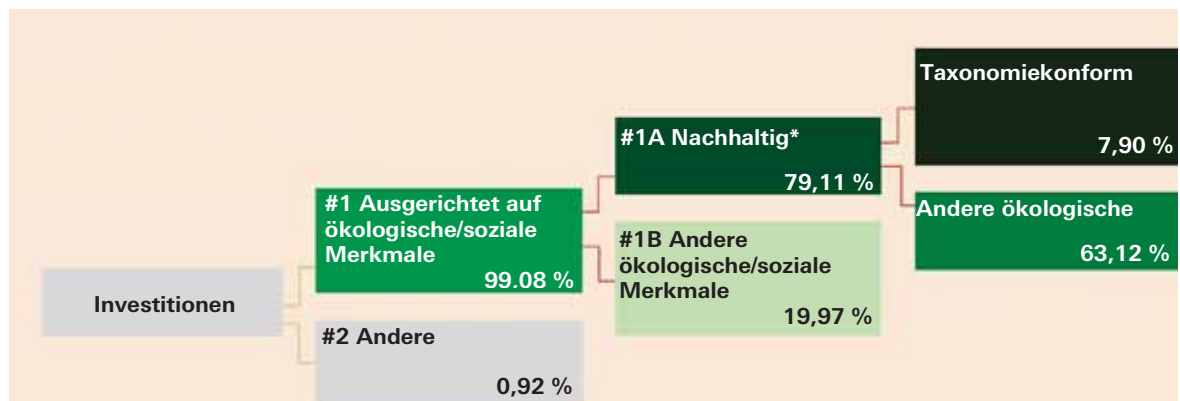


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

79,11 % des Portfolios waren in nachhaltige Vermögenswerte investiert.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?



**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**#2 Andere Investitionen** umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

\* Ein Unternehmen oder Emittent, das bzw. der als nachhaltige Investition angesehen wird, kann sowohl zu einem sozialen als auch zu einem ökologischen Ziel beitragen, das an der EU-Taxonomie ausgerichtet sein kann oder nicht. Die Zahlen in der obigen Grafik berücksichtigen dies. Jedoch darf eine Gesellschaft oder ein Emittent unter dem Punkt der nachhaltigen Investitionen (#1A Nachhaltige Investitionen) nur einmal erfasst werden.

Die Prozentzahlen von taxonomiekonformen Investitionen und Andere ökologische Merkmale stimmen aufgrund der unterschiedlichen Berechnungsmethoden für nachhaltige Investitionen und taxonomiekonforme Investitionen nicht mit #1A Nachhaltige Investitionen überein.

## In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

| Sektor / Teilsektor                            | % der Vermögenswerte |
|--|----------------------|
| Industriegüter                                 | 43,67 %              |
| Informationstechnologie                        | 28,65 %              |
| Grundstoffe                                    | 11,16 %              |
| Versorger                                      | 6,11 %               |
| <i>Stromversorgungsbetriebe</i>                | <i>2,96 %</i>        |
| <i>Multi-Versorger</i>                         | <i>0,26 %</i>        |
| Gesundheitswesen                               | 3,94 %               |
| Immobilien                                     | 2,61 %               |
| Energie  | 1,54 %               |
| <i>Raffination und Vertrieb von Öl und Gas</i> | <i>1,54 %</i>        |
| Zyklische Konsumgüter                          | 1,40 %               |
| Barmittel und Derivate                         | 0,92 %               |
| Summe  | 100,00 %             |

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



## Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

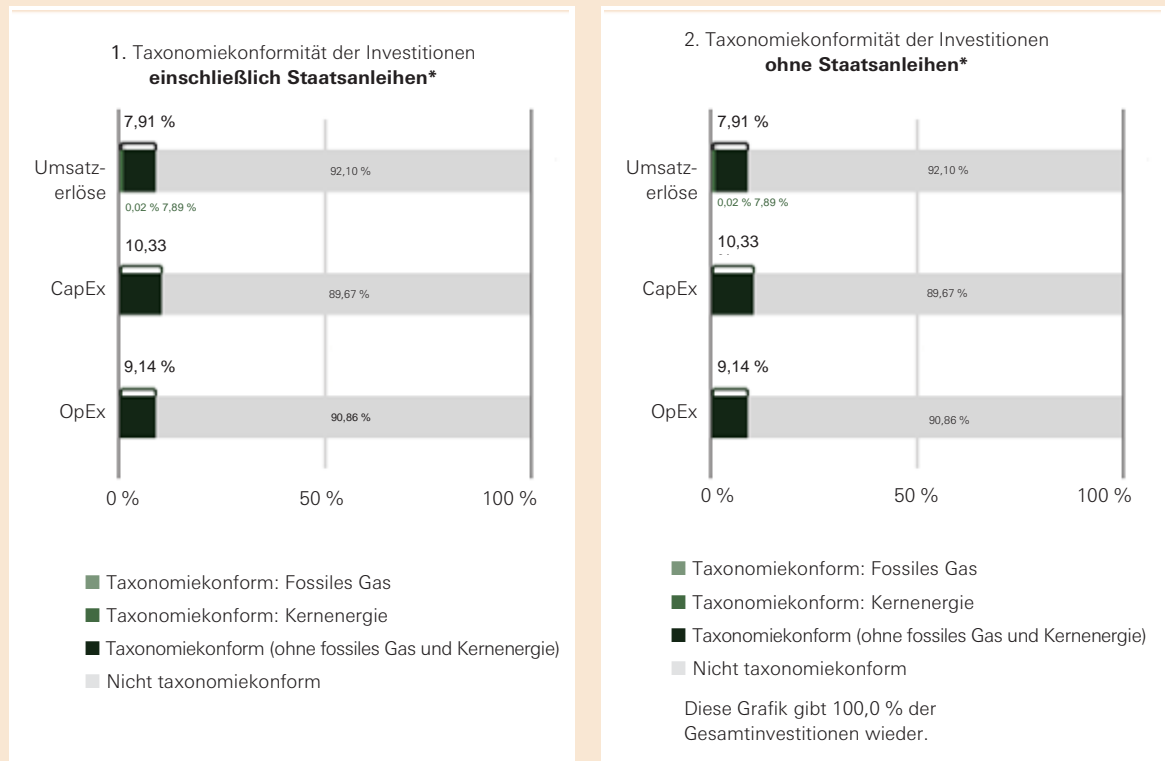
Der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen ist in den obigen Feldern zur Vermögensallokation ersichtlich.

### Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

Ja:
   
 In fossiles Gas     In Kernenergie
   
 Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



\* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

### Übergangstätigkeiten

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

### Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Im Referenzzeitraum betrug der Anteil der Investitionen des Fonds, die in Übergangstätigkeiten geflossen sind, 0,02 % und der Anteil der Investitionen, die in ermöglichende Tätigkeiten geflossen ist, 3,88 %.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar und mittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

| Indikator   | 2023-2024 | 2022-2023 |
|---|-----------|-----------|
| Umsatz – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                       | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform: Kernenergie                        | 0,02 %    | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie) | 7,89 %    | 0,00 %    |
| Umsatz – Nicht taxonomiekonform                               | 92,10 %   | 100,00 %  |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                        | 0,00 %    | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                         | n. z.     | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)  | 10,33 %   | 0,00 %    |
| CAPEX – Nicht taxonomiekonform                                | 89,67 %   | 100,00 %  |
| OPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                         | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                          | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)   | 9,14 %    | 0,00 %    |
| OPEX – Nicht taxonomiekonform                                 | 90,86 %   | 100,00 %  |

Da es sich erst um den zweiten Berichtszeitraum des Teilfonds handelt, ist ein Vergleich mit der Zeit davor nicht erforderlich.



**Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel war 63,12 %. Der Teilfonds hat sich nicht verpflichtet, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen.



**Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**


Der Teilfonds investierte nicht in sozial nachhaltige Anlagen.



**Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

#2 Andere Investitionen umfasst die Finanzinstrumente, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden. In manchen Fällen ist dies auf die Nichtverfügbarkeit von Daten und Unternehmensmaßnahmen zurückzuführen. Diese Positionen unterlagen nach wie vor dem vollständigen Ausschluss-Screening von HSBC und wurden im Hinblick auf verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Prinzipien des UNGC und der OECD geprüft.

Der Teilfonds hielt Barmittel / Barmitteläquivalente (der Prozentsatz der gehaltenen Barmittel ist in der obigen Tabelle der Sektoren/Teilsektoren unter der Überschrift „In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?“ ersichtlich) zum Zwecke des Liquiditätsmanagements sowie derivative Finanzinstrumente zum Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements. Barmittel / Barmitteläquivalente und derivative Finanzinstrumente verfügen aufgrund der Art dieser Instrumente über keinen ökologischen oder sozialen Mindestschutz.

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



## Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Der Teilfonds ist ein Teilfonds gemäß Artikel 8 der Offenlegungsverordnung mit einer thematischen Strategie. Er erfüllte sein nachhaltigen Investitionsziel, indem er in ein konzentriertes Portfolio von Unternehmen investierte, die Lösungen für das Problem des Klimawandels anbieten.

Der Teilfonds hat mindestens 80 % seines Nettovermögens in Aktien und aktienähnlichen Wertpapieren von Unternehmen investiert, die in Bereichen tätig sind, die mit dem Klimawandel zu tun haben, oder in Ökosektoren, und die in beliebigen Ländern, darunter sowohl entwickelte Märkte als auch Schwellenmärkte, domiziliert oder ansässig sind oder dort den größten Teil ihrer Geschäftstätigkeit ausüben oder dort an einem geregelten Markt notiert sind.

Der Anlageberater nutzte sowohl interne Recherchen über grüne Umsätze als auch Daten über grüne Umsätze von Dritten, um die Ausrichtung von Unternehmen in Bezug auf das Thema Klimawandel zu bewerten, wobei eine Mindestschwelle von 20 % grüner Umsätze gilt, um als thematisch ausgerichtete Anlage zu gelten. Zudem strebt das Portfolio einen um 20 % höheren ESG-Score als der MSCI ACWI und eine um 50 % niedrigere Kohlenstoffintensität als der MSCI ACWI an.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend.

● **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Nicht zutreffend.

● **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?**

Nicht zutreffend.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifizierungssystem, 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.

**Name des Produkts:** HSBC GLOBAL INVESTMENT FUNDS - GLOBAL REAL ESTATE EQUITY

**Unternehmenskennung (LEI-Code):** 213800C7RPFQKFW88Y39

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

| ●● <input type="checkbox"/> Ja  | ●○ <input checked="" type="checkbox"/> Nein  |
|---|--|
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel</b> getätigt: _ %<br><br><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><br><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><br><input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel</b> getätigt: _ % | <input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit <b>ökologische/soziale Merkmale beworben</b> und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 28,10 % an nachhaltigen Investitionen<br><br><input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><br><input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><br><input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel<br><br><input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine <b>nachhaltigen Investitionen getätigt</b> |



### Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Während des am 31. März 2024 endenden Geschäftsjahres (der Bezugszeitraum) hat der Teilfonds Folgendes beworben:

- Der Teilfonds berücksichtigte aktiv Investitionen mit geringer Kohlenstoffintensität im Vergleich zum Referenzwert
- Der Teilfonds prüfte und analysierte alle Unternehmen oder Emittenten im Hinblick auf ökologische Merkmale, insbesondere physische Risiken durch den Klimawandel und Personalmanagement. Für die zugrunde liegenden E-, S- und G-Säulen wurde ein Screening durchgeführt. „E“ und „S“ spiegeln die einzelnen Elemente der vom Teilfonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale wider, „G“ die Unternehmensführungspraktiken, die die Interessen von Minderheitsaktionären schützen und eine langfristige nachhaltige Wertschöpfung fördern.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.



Darüber hinaus berücksichtigte der Anlageberater:

1. verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Grundsätzen des Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC) und den Leitsätzen für multinationale Unternehmen der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für Unternehmen. Wurden potenzielle Verstöße gegen die Prinzipien des UNGC festgestellt, wurden die Emittenten einer eigenen Due-Diligence-Prüfung hinsichtlich ESG-Themen unterzogen, um festzustellen, ob sie für die Aufnahme in das Portfolio des Teilfonds geeignet sind, und sie auszuschließen, falls sie als ungeeignet erachtet wurden.
2. Er schloss Geschäftstätigkeiten aus, die als umweltschädlich galten, wie z. B. die Förderung von Kraftwerkskohle und die Kohleverstromung.
3. Er berücksichtigte aktiv ökologische und soziale Aspekte, indem er über unsere Engagement- und Stewardship-Teams Mitwirkung bei Emittenten umsetzte und sein Recht zur Stimmrechtsvertretung wahrnahm.
4. Er schloss nach entsprechender Analyse Anlagen in umstrittenen Waffen aus.

Die Berücksichtigung einzelner (in der nachstehenden Tabelle nummerierter) wichtigster nachteiliger Auswirkungen (PAI) drückt sich darin aus, dass der Teilfonds niedrigere Werte als der Referenzwert aufweist. Die bei der Berechnung der PAI-Werte verwendeten Daten stammen von externen Datenanbietern. Sie können auf Unternehmensangaben basieren oder von den Datenanbietern geschätzt werden, wo keine solchen Angaben vorliegen. Bitte beachten Sie, dass es nicht immer möglich ist, die Richtigkeit, Aktualität oder Vollständigkeit der von Drittanbietern bereitgestellten Daten zu garantieren.

Der Teilfonds wurde aktiv verwaltet und bildete keinen Referenzwert nach. Ein internes oder externes Ziel des Teilfonds bestand im Übertreffen des Referenzwerts, der jedoch nicht zum Erreichen der vom Teilfonds beworbenen ökologischen Merkmale diente.

Das Abschneiden der Nachhaltigkeitsindikatoren, die der Teilfonds zur Messung der Erreichung der von ihm beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet, ist in der folgenden Tabelle dargestellt.

Alle Unternehmen haben eine gute Unternehmensführung bewiesen, was sich am PAI-Score 10 unten ablesen lässt.

### **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

| <b>Indikator</b>   | <b>Teilfonds</b> | <b>Referenzwert</b> |
|--|------------------|---------------------|
| ESG-Score  | 6,21             | 6,54                |
| 1. THG-Emissionen – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente  | 3.521,35         | 3.787.332,99        |
| 2. CO <sub>2</sub> -Fußabdruck – Tonnen CO <sub>2</sub> pro Million Euro (EVIC)  | 6,16             | 7,08                |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente pro Million Euro Umsatz   | 79,88            | 77,31               |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 0,00 %           | 0,00 %              |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 0,00 %           | 0,00 %              |
| 18. Engagement in Immobilien mit schlechter Energieeffizienz   | 0,00 %           | 0,00 %              |

Die Daten in diesem regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung beziehen sich auf den Stand vom 31. März 2024, basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des am 31. März 2024 endenden Geschäftsjahres.

Referenzwert - FTSE EPRA Nareit Developed x US

## ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

| Indikator  | Zeitraum zum  | Teilfonds | Referenzwert |
|--|---------------|-----------|--------------|
| ESG-Score  | 31. März 2024 | 6,21      | 6,54         |
|  | 31. März 2023 | 0,00      | 0,00         |
| 1. THG-Emissionen – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente  | 31. März 2024 | 3.521,35  | 3.787.332,99 |
|  | 31. März 2023 | 0,00      | 0,00         |
| 2. CO <sub>2</sub> -Fußabdruck – Tonnen CO <sub>2</sub> pro Million Euro (EVIC)  | 31. März 2024 | 6,16      | 7,08         |
|  | 31. März 2023 | 0,00      | 0,00         |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente pro Million Euro Umsatz   | 31. März 2024 | 79,88     | 77,31        |
|  | 31. März 2023 | 0,00      | 0,00         |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 31. März 2024 | 0,00 %    | 0,00 %       |
|  | 31. März 2023 | 0,00 %    | 0,00 %       |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 31. März 2024 | 0,00 %    | 0,00 %       |
|  | 31. März 2023 | 0,00 %    | 0,00 %       |
| 18. Engagement in Immobilien mit schlechter Energieeffizienz   | 31. März 2024 | 0,00 %    | 0,00 %       |
|  | 31. März 2023 | 0,00 %    | 0,00 %       |

Da es sich erst um den zweiten regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung handelt, ist kein Vergleich mit vorangegangenen Zeiträumen möglich.

## **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die vom Teilfonds getätigten nachhaltigen Investitionen trugen unter anderem zu folgenden ökologischen Zielen bei:

1. Reduzierung von Treibhausgasemissionen und Verringerung des CO<sub>2</sub>-Fußabdrucks;
2. Übergang zu oder die Nutzung von erneuerbarer Energie.

## **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Wir bestätigen, dass wir nachhaltige Vermögenswerte darauf geprüft haben, ob sie erhebliche Beeinträchtigungen verursachen können. Dies erfolgte im Rahmen des Standard-Anlageprozesses von HSBC Asset Management (HSBC) und unter Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen.

*Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?*

Der Anlageberater hat alle durch die Offenlegungsverordnung definierten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI) auf ihre Relevanz für den Teilfonds geprüft. Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren legt fest, wie HSBC die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen identifiziert und darauf reagiert, und in welcher Form HSBC Nachhaltigkeitsrisiken berücksichtigt, die sich negativ auf Wertpapiere auswirken können, in die der Teilfonds investiert. HSBC identifizierte in Zusammenarbeit mit externen Screening-Dienstleistern, wie Sustainalytics, ISS, MSCI und Trucost, Unternehmen und Regierungen mit schlechter Bilanz beim Management von ESG-Risiken, und wo solche wesentlichen Risiken identifiziert wurden, führte HSBC zusätzliche ESG-Due-Diligence-Prüfungen durch. Durch Screening identifizierte Nachhaltigkeitsauswirkungen einschließlich der PAI bildeten einen Schlüsselfaktor beim Anlageentscheidungsprozess.

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 oben beschriebene Ansatz führte dazu, dass unter anderem folgende Faktoren geprüft wurden:

- Engagement der Unternehmen für den Übergang zu CO2-armen Wirtschaften, zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern, Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus großen Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails; und
- Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit folgenden Bereichen: demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.

Die spezifischen PAI für diesen Teilfonds waren wie unten beschrieben.

Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren ist auf der Website [www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies](http://www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies) verfügbar.

*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:*

HSBC hat sich der Anwendung und Förderung globaler Standards verpflichtet. Die wichtigsten Schwerpunktbereiche der Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren entsprachen den zehn UNGC-Grundsätzen. Diese Grundsätze stehen in Zusammenhang mit nicht finanziellen Risiken in den Bereichen Menschenrechte, Arbeit, Umweltschutz und Korruptionsbekämpfung. HSBC gehört darüber hinaus zu den Unterzeichnern der UN Principles for Responsible Investment. Diese bildeten den Rahmen für Ermittlung und Management von Nachhaltigkeitsrisiken beim Investmentansatz von HSBC. Von Unternehmen, in die der Teilfonds investierte, wurde erwartet, dass sie die Anforderungen des UNGC und der damit verbundenen Standards erfüllen. Unternehmen, die belegbar gegen einen der zehn Grundsätze des UNGC verstießen, wurden systematisch ausgeschlossen. Der Teilfonds führte verstärkte Due-Diligence-Prüfungen bei Unternehmen durch, die als nicht konform mit den Prinzipien des UNGC angesehen wurden oder die nach den unternehmenseigenen ESG Ratings von HSBC als risikoreich angesehen wurden. Darüber hinaus wurden die Unternehmen nach internationalen Standards wie den OECD-Leitsätzen bewertet.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen. Hierbei gelten spezifische von der Union definierte Kriterien.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*



## Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Teilfonds berücksichtigte die folgenden PAI, indem er sie als Nachhaltigkeitsindikatoren beobachtete:

- Treibhausgasemissionen (Scope 1 und Scope 2)
- CO<sub>2</sub>-Fußabdruck (Scope 1 und Scope 2)
- Treibhausgasintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1 und Scope 2)
- Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
- Verstöße gegen die UNGC- und OECD-Grundsätze; und
- Anteil der Investitionen mit Beteiligung an umstrittenen Waffen

Der Ansatz zur Berücksichtigung der PAI beinhaltete unter anderem, dass HSBC das Engagement der Unternehmen für den Übergang zu CO<sub>2</sub>-armen Wirtschaften, die zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern sowie die Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette prüfte, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails. Ebenfalls berücksichtigt wurde das Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit den Bereichen demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung. Ausgeschlossen waren auch Unternehmen, deren Geschäftsaktivitäten als umweltschädlich eingestuft wurden.

Das Screening führte dazu, dass HSBC nicht in bestimmte Unternehmen und Emittenten investierte.



## Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der Investitionen entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden: basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des Bezugszeitraums zum 31.03.2024

| Größte Investitionen                   | Sektor     | % der Vermögenswerte | Land  |
|--|------------|----------------------|---|
| Prologis, Inc.                         | Immobilien | 7,05 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| Invitation Homes, Inc.                 | Immobilien | 3,26 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| Welltower Inc.                         | Immobilien | 3,17 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| Realty Income Corporation              | Immobilien | 3,09 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| SEGRO plc                              | Immobilien | 2,90 %               | Vereinigtes Königreich von Großbritannien und Nordirland. |
| Warehouses De Pauw SA                  | Immobilien | 2,81 %               | Belgien   |
| Public Storage                         | Immobilien | 2,78 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| CapitaLand Integrated Commercial Trust | Immobilien | 2,76 %               | Singapur  |
| Equinix, Inc.                          | Immobilien | 2,63 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| Simon Property Group, Inc.             | Immobilien | 2,60 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| Ventas, Inc.                           | Immobilien | 2,58 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| Regency Centers Corporation            | Immobilien | 2,55 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| Kimco Realty Corporation               | Immobilien | 2,52 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| Federal Realty Investment Trust        | Immobilien | 2,44 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| Rexford Industrial Realty, Inc.        | Immobilien | 2,35 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |

Barmittel und Derivate wurden nicht berücksichtigt

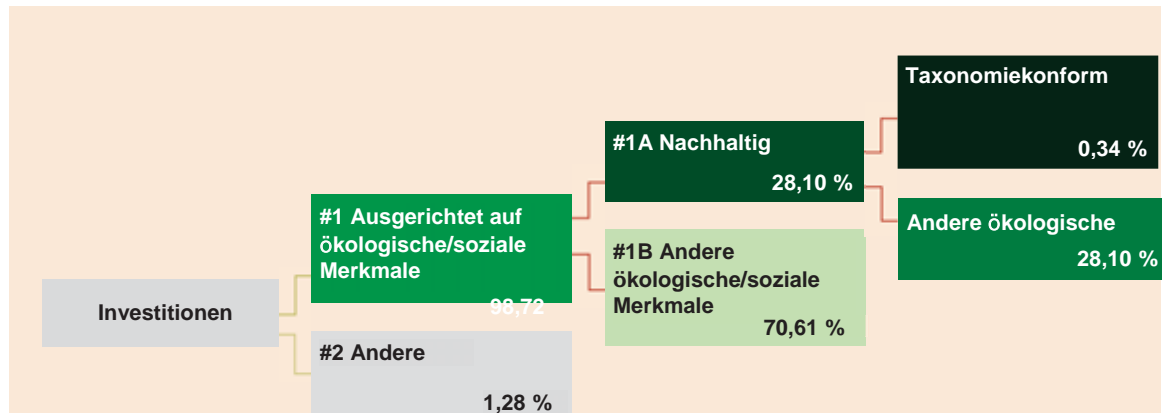


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

28,10 % des Portfolios waren in nachhaltige Vermögenswerte investiert.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?



**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**#2 Andere Investitionen** umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

\* Ein Unternehmen oder Emittent, das bzw. der als nachhaltige Investition angesehen wird, kann sowohl zu einem sozialen als auch zu einem ökologischen Ziel beitragen, das an der EU-Taxonomie ausgerichtet sein kann oder nicht. Die Zahlen in der obigen Grafik berücksichtigen dies. Jedoch darf eine Gesellschaft oder ein Emittent unter dem Punkt der nachhaltigen Investitionen (#1A Nachhaltige Investitionen) nur einmal erfasst werden.

Die Prozentzahlen von taxonomiekonformen Investitionen und Andere ökologische Merkmale stimmen aufgrund der unterschiedlichen Berechnungsmethoden für nachhaltige Investitionen und taxonomiekonforme Investitionen nicht mit #1A Nachhaltige Investitionen überein.

### In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

| Sektor / Teilsektor    | % der Vermögenswerte |
|------------------------|----------------------|
| Immobilien             | 98,72 %              |
| Barmittel und Derivate | 1,28 %               |
| Summe                  | 100,00 %             |



Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

## Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

Der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen ist in den obigen Feldern zur Vermögensallokation ersichtlich.

### Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

Ja:

In fossiles Gas       In Kernenergie

Nein

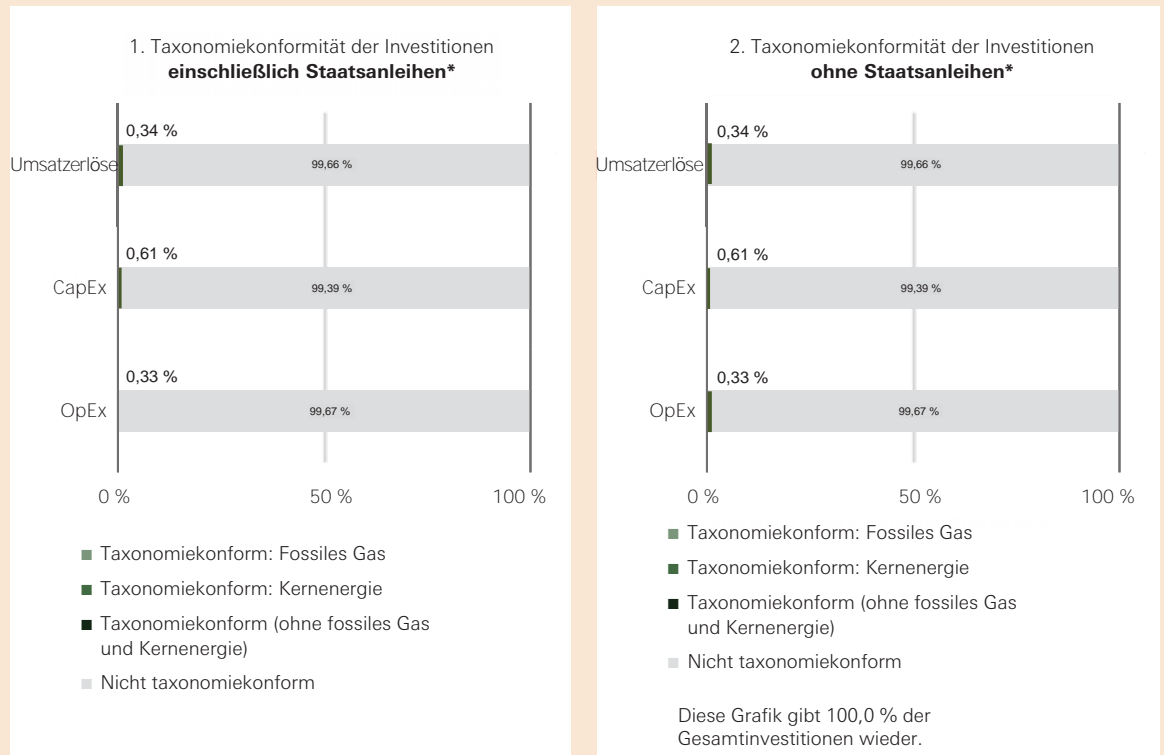
<sup>1</sup> Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

**Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

**Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.**



\* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

### Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?


Im Referenzzeitraum betrug der Anteil der Investitionen des Fonds, die in Übergangstätigkeiten geflossen sind, 0,00 % und der Anteil der Investitionen, die in ermöglichende Tätigkeiten geflossen ist, 0,00 %.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**


| Indikator   | 2023-2024 | 2022-2023 |
|---|-----------|-----------|
| Umsatz – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                       | n. z.     | n. z.     |
| Umsatz – Taxonomiekonform: Kernenergie                        | n. z.     | n. z.     |
| Umsatz – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie) | 0,34 %    | n. z.     |
| Umsatz – Nicht taxonomiekonform                               | 99,66 %   | n. z.     |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                        | n. z.     | n. z.     |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                         | n. z.     | n. z.     |
| CAPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)  | 0,61 %    | n. z.     |
| CAPEX – Nicht taxonomiekonform                                | 99,39 %   | n. z.     |
| OPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                         | n. z.     | n. z.     |
| OPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                          | n. z.     | n. z.     |
| OPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)   | 0,33 %    | n. z.     |
| OPEX – Nicht taxonomiekonform                                 | 99,67 %   | n. z.     |

Da es sich erst um den zweiten Berichtszeitraum des Teilfonds handelt, ist ein Vergleich mit der Zeit davor nicht erforderlich.

 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?**

Der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel war 28,10 %. Der Teilfonds hat sich nicht verpflichtet, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen.

 **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Teilfonds investierte nicht in sozial nachhaltige Anlagen.

 **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

#2 Andere Investitionen umfasst die Finanzinstrumente, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden. In manchen Fällen ist dies auf die Nichtverfügbarkeit von Daten und Unternehmensmaßnahmen zurückzuführen. Diese Positionen unterlagen nach wie vor dem vollständigen Ausschluss-Screening von HSBC und wurden im Hinblick auf verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Prinzipien des UNGC und der OECD geprüft.

Der Teilfonds hielt Barmittel / Barmitteläquivalente (der Prozentsatz der gehaltenen Barmittel ist in der obigen Tabelle der Sektoren/Teilektoren unter der Überschrift „In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?“ ersichtlich) zum Zwecke des Liquiditätsmanagements sowie derivative Finanzinstrumente zum Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements. Barmittel / Barmitteläquivalente und derivative Finanzinstrumente verfügen aufgrund der Art dieser Instrumente über keinen ökologischen oder sozialen Mindestschutz.





## Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Im Laufe des Berichtszeitraums schloss der Anlageberater unter anderem verbotene Waffen, umstrittene Waffen, Unternehmen, die mehr als 10 % ihres Umsatzes aus Kraftwerkskohle und Energieerzeugung aus Kohle generieren, und Tabakherstellung aus und investierte in Unternehmen mit verantwortungsvollen Geschäftspraktiken gemäß den Prinzipien des UNGC.

Nach der Identifizierung des zulässigen Anlageuniversums konstruierte der Anlageberater ein Portfolio, dessen CO<sub>2</sub>-Intensität (berechnet als gewichteter Durchschnitt der CO<sub>2</sub>-Intensitäten der Anlagen des Teilfonds) niedriger ist als der gewichtete Durchschnitt der Bestandteile des Referenzwerts. Dies führte zu einem PAI-Score, der unter dem Referenzwert lag. Der Teilfonds bewertete auch ESG-Scores mit dem Ergebnis, dass der ESG-Score während des gesamten Berichtszeitraums über dem des Referenzwerts lag.

Darüber hinaus wurden alle Positionen auf Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der OECD untersucht, um Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung innerhalb des Portfolios sicherzustellen.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Nicht zutreffend.

- **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?**

Nicht zutreffend.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführ-

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.

Name des Produkts: HSBC GLOBAL INVESTMENT FUNDS - GLOBAL SUSTAINABLE EQUITY INCOME

Unternehmenskennung (LEI-Code): 213800P8MQVXCNL9A447

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

| <input checked="" type="checkbox"/> <input checked="" type="checkbox"/> <input type="checkbox"/> <b>Ja</b>   | <input checked="" type="checkbox"/> <input type="checkbox"/> <input checked="" type="checkbox"/> <b>Nein</b>  |
|--|---|
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel</b> getätigt: _ %<br><br><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><br><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit <b>ökologische/soziale Merkmale beworben</b> und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 38,64 % an nachhaltigen Investitionen<br><br><input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><br><input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><br><input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel |
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel</b> getätigt: _ %  | <input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine <b>nachhaltigen Investitionen getätigt</b>   |



### Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Während des Geschäftsjahres zum 31. März 2024 (der Bezugszeitraum) bewarb der Teilfonds die folgenden Merkmale:

- Der Teilfonds berücksichtigte aktiv Investitionen mit geringer Kohlenstoffintensität, und der ESG-Score wurde so gestaltet, dass er im Vergleich zum Index einen höheren Wert aufweist.
- Der Teilfonds berücksichtigte verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Grundsätzen des Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC) und den Leitsätzen für multinationale Unternehmen der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für Unternehmen.
- Der Teilfonds schloss Geschäftstätigkeiten aus, die als umweltschädlich gelten, wie z. B. die Förderung von Kraftwerkskohle und die Kohleverstromung.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

4. Der Teilfonds prüfte und analysierte alle Unternehmen oder Emittenten im Hinblick auf ökologische Merkmale, insbesondere physische Risiken durch den Klimawandel und Personalmanagement. Für die zugrunde liegenden E-, S- und G-Säulen wurden ein Screening sowie ein Vergleich mit dem für den Teilfonds definierten Referenzwert durchgeführt. „E“ und „S“ spiegeln die einzelnen Elemente der vom Teilfonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale wider, „G“ die Unternehmensführungspraktiken, die die Interessen von Minderheitsaktionären schützen und eine langfristige nachhaltige Wertschöpfung fördern.
5. Der Teilfonds berücksichtigte aktiv ökologische und soziale Aspekte, indem er über unsere Engagement- und Stewardship-Teams Mitwirkung bei Emittenten umsetzte und sein Recht zur Stimmrechtsvertretung wahrnahm.
6. Der Teilfonds schloss Anlagen in umstrittenen Waffen aus.

Der ESG-Score wird von einem Drittanbieter von ESG-Daten übernommen. MSCI. Die Berücksichtigung einzelner (in der nachstehenden Tabelle nummerierter) wichtigster nachteiliger Indikatoren (PAI) drückt sich darin aus, dass der Teilfonds niedrigere Werte als der Referenzwert aufweist. Die bei der Berechnung der PAI-Werte verwendeten Daten stammen von externen Datenanbietern. Sie können auf Unternehmensangaben basieren oder von den Datenanbietern geschätzt werden, wo keine solchen Angaben vorliegen. Bitte beachten Sie, dass es nicht immer möglich ist, die Richtigkeit, Aktualität oder Vollständigkeit der von Drittanbietern bereitgestellten Daten zu garantieren.

Der Referenzwert wurde zur Messung der Kohlenstoffintensität und Festlegung der ESG-Scores herangezogen, diente aber nicht der Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale des Teilfonds.

Das Abschneiden der Nachhaltigkeitsindikatoren, die der Teilfonds zur Messung der Erreichung der von ihm beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet, ist in der folgenden Tabelle dargestellt.

Alle Unternehmen haben eine gute Unternehmensführung bewiesen, was sich am PAI-Score 10 unten ablesen lässt.

### ● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

| <b>Indikator</b>   | <b>Teilfonds</b> | <b>Referenzwert</b> |
|--|------------------|---------------------|
| ESG-Score  | 8,33             | 6,87                |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO2-Äquivalente pro Million Euro Umsatz  | 58,37            | 109,67              |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 0,00 %           | 0,69 %              |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 0,00 %           | 0,24 %              |

Die Daten in diesem regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung beziehen sich auf den Stand vom 31. März 2024, basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des am 31. März 2024 endenden Geschäftsjahres.

Referenzwert – MSCI World

## ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

| Indikator  | Zeitraum zum  | Teilfonds | Referenzwert |
|--|---------------|-----------|--------------|
| ESG-Score  | 31. März 2024 | 8,33      | 6,87         |
|  | 31. März 2023 | 8,43      | 6,94         |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente pro Million Euro Umsatz   | 31. März 2024 | 58,37     | 109,67       |
|  | 31. März 2023 | 80,46     | 144,58       |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 31. März 2024 | 0,00 %    | 0,69 %       |
|  | 31. März 2023 | 0,00 %    | 0,80 %       |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 31. März 2024 | 0,00 %    | 0,24 %       |
|  | 31. März 2023 | 0,00 %    | 0,00 %       |

Da es sich erst um den zweiten regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung handelt, ist kein Vergleich mit vorangegangenen Zeiträumen möglich.

Ab November 2023 wurden diesem Teilfonds PAI 2 – CO<sub>2</sub>-Fußabdruck fälschlicherweise als Nachhaltigkeitsindikator zugewiesen und im Januar 2024 wieder entfernt. Daher haben wir über diesen PAI nicht berichtet.

PAI 1 – Treibhausgasemissionen wurde im November 2023 hinzugefügt. Über ihn wird im nächsten regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung ausführlich berichtet.

## Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Die vom Teilfonds getätigten nachhaltigen Investitionen trugen unter anderem zu folgenden ökologischen Zielen bei:

1. Reduzierung von Treibhausgasemissionen und Verringerung des CO<sub>2</sub>-Fußabdrucks;
2. Übergang zu oder die Nutzung von erneuerbarer Energie.

Der Teilfonds bezog die Identifizierung und Analyse der ESG-Referenzen eines Unternehmens als integralen Bestandteil in den Anlageentscheidungsprozess ein, um die Bewertung von Risiken und potenziellen Renditen zu unterstützen. Der Teilfonds beinhaltete die Identifizierung und Analyse von ESG-Referenzen eines Unternehmens als wesentlichen Bestandteil des Anlageentscheidungsprozesses mit dem Ziel der Reduzierung von Nachhaltigkeitsrisiken und Steigerung von Renditen.

## Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Wir bestätigen, dass wir nachhaltige Vermögenswerte darauf geprüft haben, ob sie erhebliche Beeinträchtigungen verursachen können. Dies erfolgte im Rahmen des Standard-Anlageprozesses von HSBC Asset Management (HSBC) und unter Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen.

### Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageberater hat alle durch die Offenlegungsverordnung definierten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI) auf ihre Relevanz für den Teilfonds geprüft. Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren legt fest, wie HSBC die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen identifiziert und darauf reagiert, und in welcher Form HSBC Nachhaltigkeitsrisiken berücksichtigt, die sich negativ auf Wertpapiere auswirken können, in die der Teilfonds investiert. HSBC identifizierte in Zusammenarbeit mit externen Screening-Dienstleistern wie Sustainalytics, ISS, MSCI und Trucost Unternehmen und Staaten mit schlechter Bilanz beim Management von ESG-Risiken, und wo solche wesentlichen Risiken identifiziert wurden, führte HSBC zusätzliche Due Diligence-Prüfungen durch. Durch Screening identifizierte Nachhaltigkeitsauswirkungen, einschließlich der relevanten PAI, bildeten einen Schlüsselfaktor beim Anlageentscheidungsprozess.

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 oben beschriebene Ansatz führte dazu, dass unter anderem folgende Faktoren geprüft wurden:

- Engagement der Unternehmen für den Übergang zu CO2-armen Wirtschaften, zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern, Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus großen Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails; und
- Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit folgenden Bereichen: demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.

Die spezifischen PAI für diesen Teilfonds waren wie unten beschrieben.

Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsvolles Investieren ist auf der Website verfügbar unter: [www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies](http://www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies).

*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:*

HSBC hat sich der Anwendung und Förderung globaler Standards verpflichtet. Die wichtigsten Schwerpunktbereiche der Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren entsprachen den zehn UNGC-Grundsätzen. Diese Grundsätze stehen in Zusammenhang mit nicht finanziellen Risiken in den Bereichen Menschenrechte, Arbeit, Umweltschutz und Korruptionsbekämpfung. HSBC gehört darüber hinaus zu den Unterzeichnern der UN Principles for Responsible Investment. Diese bildeten den Rahmen für Ermittlung und Management von Nachhaltigkeitsrisiken beim Investmentansatz von HSBC. Von Unternehmen, in die der Teilfonds investierte, wurde erwartet, dass sie die Anforderungen des UNGC und der damit verbundenen Standards erfüllen. Unternehmen, die belegbar gegen einen der zehn Grundsätze des UNGC verstießen, wurden systematisch ausgeschlossen. Der Teilfonds führte verstärkte Due-Diligence-Prüfungen bei Unternehmen durch, die als nicht konform mit den Prinzipien des UNGC angesehen wurden oder die nach den unternehmenseigenen ESG Ratings von HSBC als risikoreich angesehen wurden. Darüber hinaus wurden die Unternehmen nach internationalen Standards wie den OECD-Leitsätzen bewertet.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen. Hierbei gelten spezifische von der Union definierte Kriterien.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*



## Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Teilfonds berücksichtigte die folgenden PAI, indem er sie als Nachhaltigkeitsindikatoren beobachtete:

- Treibhausgasemissionen (Scope 1 und Scope 2) (im November 2023 hinzugefügt, siehe Fußnote unter der Wertentwicklungstabelle oben)
- Treibhausgasintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1 und Scope 2)
- Verstöße gegen die Prinzipien des UNGC und gegen die Leitsätze der OECD und
- Anteil der Investitionen mit Beteiligung an umstrittenen Waffen

Der Ansatz zur Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen beinhaltete unter anderem, dass HSBC das Engagement der Unternehmen für den Übergang zu kohlenstoffarmem Wirtschaften, die zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern sowie die Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette prüfte, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails. Ebenfalls berücksichtigt wurde das Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit den Bereichen demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung. Ausgeschlossen waren auch Unternehmen, deren Geschäftsaktivitäten als umweltschädlich eingestuft wurden.

Das Screening führte dazu, dass HSBC nicht in bestimmte Unternehmen und Emittenten investierte.



## Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der Investitionen** entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden: basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des Bezugszeitraums zum 31.03.2024

| <b>Größte Investitionen</b>    | <b>Sektor</b>                  | <b>% der Vermögenswerte</b> | <b>Land</b>                    |
|--------------------------------|--------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|
| Microsoft Corporation          | Informationstechnologie        | 5,54 %                      | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Apple Inc.                     | Informationstechnologie        | 4,12 %                      | Vereinigte Staaten von Amerika |
| NVIDIA Corporation             | Informationstechnologie        | 3,14 %                      | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Amazon.com, Inc.               | Zyklische Konsumgüter          | 1,48 %                      | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Home Depot, Inc.               | Zyklische Konsumgüter          | 1,48 %                      | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Novo Nordisk A/S Class B       | Gesundheitswesen               | 1,47 %                      | Dänemark                       |
| ASML Holding NV                | Informationstechnologie        | 1,34 %                      | Niederlande                    |
| Merck & Co., Inc.              | Gesundheitswesen               | 1,27 %                      | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Adobe Inc.                     | Informationstechnologie        | 1,26 %                      | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Alphabet Inc. Class C          | Kommunikationsdienstleistungen | 1,21 %                      | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Cisco Systems, Inc.            | Informationstechnologie        | 1,21 %                      | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Coca-Cola Company              | Basiskonsumgüter               | 1,20 %                      | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Applied Materials, Inc.        | Informationstechnologie        | 1,13 %                      | Vereinigte Staaten von Amerika |
| PepsiCo, Inc.                  | Basiskonsumgüter               | 1,12 %                      | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Texas Instruments Incorporated | Informationstechnologie        | 1,12 %                      | Vereinigte Staaten von Amerika |

Barmittel und Derivate wurden nicht berücksichtigt

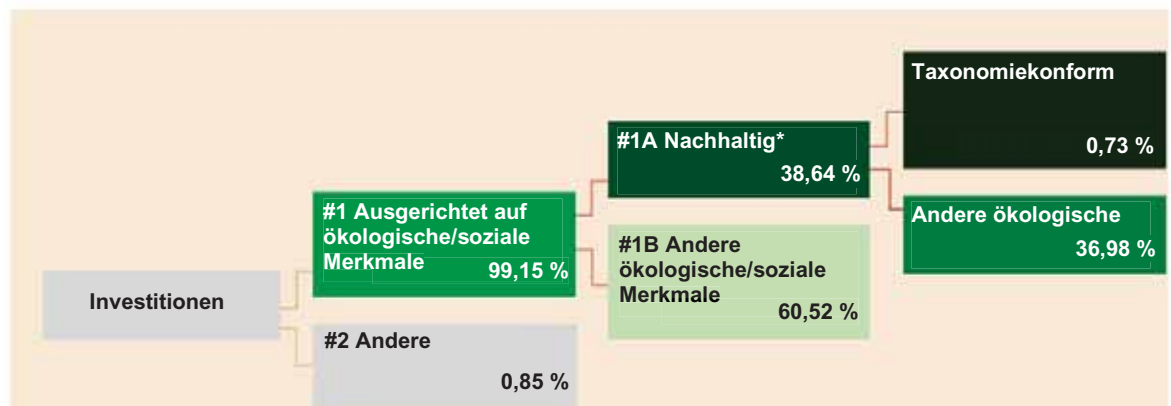


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

38,64 % des Portfolios waren in nachhaltige Vermögenswerte investiert.

Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?



**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**#2 Andere Investitionen** umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

\* Ein Unternehmen oder Emittent, das bzw. der als nachhaltige Investition angesehen wird, kann sowohl zu einem sozialen als auch zu einem ökologischen Ziel beitragen, das an der EU-Taxonomie ausgerichtet sein kann oder nicht. Die Zahlen in der obigen Grafik berücksichtigen dies. Jedoch darf eine Gesellschaft oder ein Emittent unter dem Punkt der nachhaltigen Investitionen (#1A Nachhaltige Investitionen) nur einmal erfasst werden.

Die Prozentzahlen von taxonomiekonformen Investitionen und Andere ökologische Merkmale stimmen aufgrund der unterschiedlichen Berechnungsmethoden für nachhaltige Investitionen und taxonomiekonforme Investitionen nicht mit #1A Nachhaltige Investitionen überein.



**In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

| Sektor / Teilsektor                                   | % der Vermögenswerte |
|---|----------------------|
| Informationstechnologie                               | 24,87 %              |
| Finanzen  | 14,23 %              |
| Industriegüter  | 13,33 %              |
| Gesundheitswesen                                      | 11,40 %              |
| Zyklische Konsumgüter                                 | 10,61 %              |
| Basiskonsumgüter                                      | 7,86 %               |
| Kommunikationsdienstleistungen                        | 4,87 %               |
| Immobilien  | 4,08 %               |
| Energie   | 3,04 %               |
| .....   |                      |
| <i>Integrierter Öl- und Gaskonzern</i>                | <i>1,28 %</i>        |
| .....   |                      |
| <i>Ausrüstung und Dienstleistungen für Öl und Gas</i> | <i>0,27 %</i>        |
| .....   |                      |
| <i>Exploration und Produktion von Öl und Gas</i>      | <i>1,07 %</i>        |
| .....   |                      |
| <i>Lagerung und Transport von Öl und Gas</i>          | <i>0,42 %</i>        |
| Grundstoffe   | 2,44 %               |
| Versorger   | 2,41 %               |
| .....   |                      |
| <i>Stromversorgungsbetriebe</i>                       | <i>0,72 %</i>        |
| .....   |                      |
| <i>Erdgas</i>   | <i>0,15 %</i>        |
| .....   |                      |
| <i>Multi-Versorger</i>                                | <i>1,55 %</i>        |
| Barmittel und Derivate                                | 0,85 %               |
| Summe   | 100,00 %             |

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO2-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.



**Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?**

Der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen ist in den obigen Feldern zur Vermögensallokation ersichtlich.

**Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?**

Ja:
  In fossiles Gas
  In Kernenergie  
 Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen.

- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

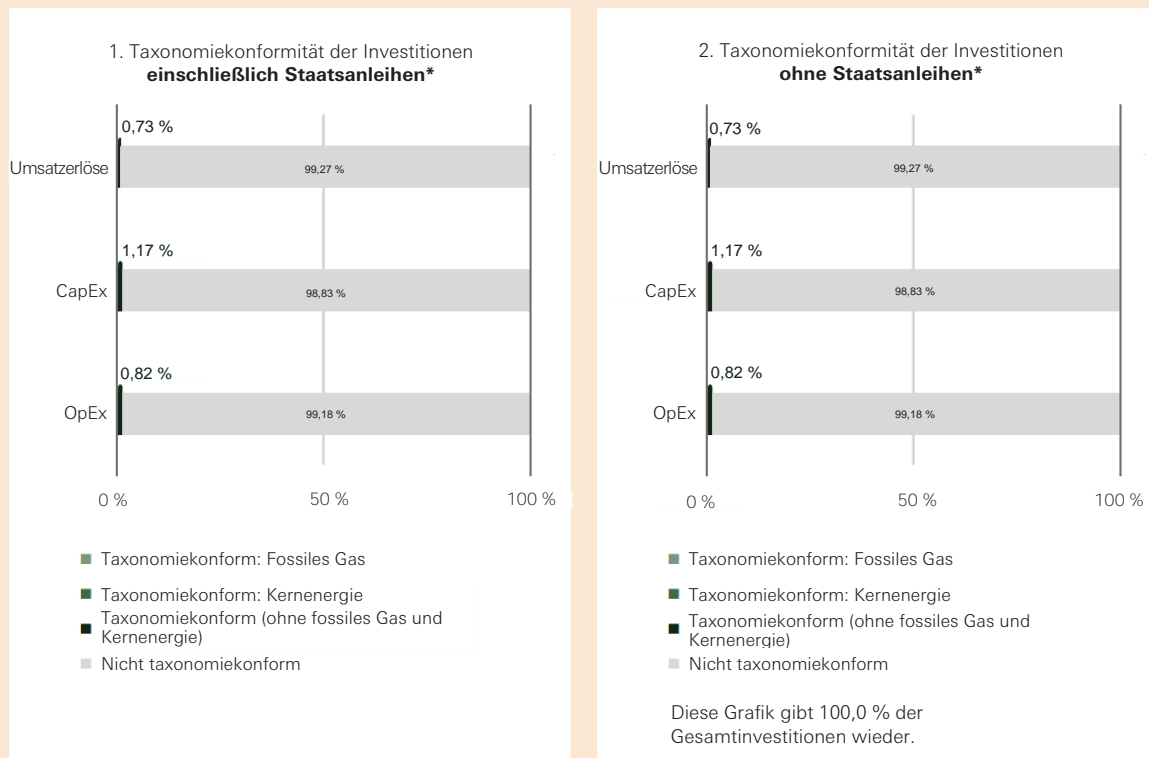
### Übergangstätigkeiten

sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

### Ermöglichende Tätigkeiten

wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

**Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.**



\* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

### Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Im Referenzzeitraum betrug der Anteil der Investitionen des Fonds, die in Übergangstätigkeiten geflossen sind, 0,10 % und der Anteil der Investitionen, die in ermöglichende Tätigkeiten geflossen ist, 0,63 %.

### Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

| Indikator   | 2023-2024 | 2022-2023 |
|---|-----------|-----------|
| Umsatz – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                       | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform: Kernenergie                        | 0,00 %    | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie) | 0,73 %    | 0,00 %    |
| Umsatz – Nicht taxonomiekonform                               | 99,27 %   | 100,00 %  |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                        | n. z.     | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                         | 0,00 %    | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)  | 1,17 %    | 0,00 %    |
| CAPEX – Nicht taxonomiekonform                                | 98,83 %   | 100,00 %  |
| OPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                         | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                          | 0,00 %    | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)   | 0,82 %    | 0,00 %    |
| OPEX – Nicht taxonomiekonform                                 | 99,18 %   | 100,00 %  |

Da es sich erst um den zweiten Berichtszeitraum des Teilfonds handelt, ist ein Vergleich mit der Zeit davor nicht erforderlich.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeit en 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?**

Der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel war 36,98 %. Der Teilfonds hat sich nicht verpflichtet, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen.



### **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Teilfonds investierte nicht in sozial nachhaltige Anlagen.



### **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

#2 Andere Investitionen umfasst die Finanzinstrumente, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden. In manchen Fällen ist dies auf die Nichtverfügbarkeit von Daten und Unternehmensmaßnahmen zurückzuführen. Diese Positionen unterlagen nach wie vor dem vollständigen Ausschluss-Screening von HSBC und wurden im Hinblick auf verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Prinzipien des UNGC und der OECD geprüft.

Der Teilfonds hielt Barmittel / Barmitteläquivalente (der Prozentsatz der gehaltenen Barmittel ist in der obigen Tabelle der Sektoren/Teilektoren unter der Überschrift „In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?“ ersichtlich) zum Zwecke des Liquiditätsmanagements sowie derivative Finanzinstrumente zum Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements. Barmittel / Barmitteläquivalente und derivative Finanzinstrumente verfügen aufgrund der Art dieser Instrumente über keinen ökologischen oder sozialen Mindestschutz.



### **Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?**

Im Laufe des Berichtszeitraums schloss der Anlageberater unter anderem verbotene Waffen, umstrittene Waffen, Unternehmen, die mehr als 10 % ihres Umsatzes aus Kraftwerkskohle und Energieerzeugung aus Kohle generieren, und Tabakherstellung aus und investierte in Unternehmen mit verantwortungsvollen Geschäftspraktiken gemäß den Prinzipien des UNGC.

Alle Positionen im Portfolio wurden hinsichtlich ihrer individuellen Kohlenstoffintensität untersucht, was zu einer Kohlenstoffintensität des Portfolios führte, die besser als die des Referenzwerts war. Der Teilfonds bewertete auch ESG-Scores mit dem Ergebnis, dass der ESG-Score während des gesamten Berichtszeitraums über dem des Referenzwerts lag.

Wurden außerdem wesentliche ESG-Risiken oder ein potenzieller Verstoß gegen einen oder mehrere der zehn Prinzipien des UNGC festgestellt, führte der Portfoliomanager/Analyst eine intensive Due-Diligence-Prüfung in Bezug auf ESG-Themen durch. Zudem war die Genehmigung des Investitionsausschusses erforderlich, bevor Investitionen getätigt werden konnten.



### **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

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?***

Nicht zutreffend.

- ***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?***

Nicht zutreffend.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?***

Nicht zutreffend.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?***

Nicht zutreffend.

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen 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.

**Name des Produkts:** HSBC GLOBAL INVESTMENT FUNDS - GLOBAL EQUITY SUSTAINABLE HEALTHCARE

**Unternehmenskennung (LEI-Code):** 213800J1JR4OJRQIMV56

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

| Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?  |  |
|--|--|
| <input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> Ja  | <input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> Nein  |
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel</b> getätigt: _ %<br><br><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><br><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit <b>ökologische/soziale Merkmale beworben</b> und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 43,68 % an nachhaltigen Investitionen<br><br><input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><br><input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><br><input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel |
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel</b> getätigt: _ %  | <input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber <b>keine nachhaltigen Investitionen getätigt</b>  |



### Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Während des Geschäftsjahres zum 31. März 2024 (der Bezugszeitraum) bewarb der Teilfonds Folgendes:

- Der Teilfonds investierte in ein konzentriertes Portfolio aus Aktien von Unternehmen, die von den weltweit knapper werdenden Budgets im Gesundheitswesen profitierten.
- Der Teilfonds berücksichtigte verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Grundsätzen des Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC) und den Leitsätzen für multinationale Unternehmen der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für Unternehmen. Wurden potenzielle Verstöße gegen die Prinzipien des UNGC festgestellt, wurden die Emittenten einer eigenen Due-

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Diligence-Prüfung hinsichtlich ESG-Themen unterzogen, um festzustellen, ob sie für die Aufnahme in das Portfolio des Teilfonds geeignet sind, und sie auszuschließen, falls sie als ungeeignet erachtet wurden.

3. Der Teilfonds schloss Geschäftstätigkeiten aus, die als umweltschädlich gelten, wie z. B. die Förderung von Kraftwerkskohle und die Kohleverstromung.
4. Der Teilfonds ermittelte und analysierte die sozialen Merkmale von Unternehmen, unter anderem im Hinblick auf den Zugang zu Gesundheitsversorgung.
5. Der Teilfonds berücksichtigte aktiv ökologische und soziale Aspekte, indem er über unsere Engagement- und Stewardship-Teams Mitwirkung bei Emittenten umsetzte und sein Recht zur Stimmrechtsvertretung wahrnahm.

Die auf Nachhaltigkeitsindikatoren bezogenen Scores werden anhand der proprietären Methodik von HSBC Asset Management und externer ESG-Datenanbieter berechnet. Berücksichtigung einzelner PAI (in der nachstehenden Tabelle durch die vorangestellte Nummer angegeben). Die bei der Berechnung der PAI-Werte verwendeten Daten stammen von externen Datenanbietern. Sie können auf Unternehmensangaben basieren oder von den Datenanbietern geschätzt werden, wo keine solchen Angaben vorliegen. Bitte beachten Sie, dass es nicht immer möglich ist, die Richtigkeit, Aktualität oder Vollständigkeit der von Drittanbietern bereitgestellten Daten zu garantieren.

Der Referenzwert diente zum Vergleich des Teilfonds mit dem allgemeinen Markt, nicht jedoch der Erreichung der vom Teilfonds beworbenen sozialen Merkmale.

Das Abschneiden der Nachhaltigkeitsindikatoren, die der Teilfonds zur Messung der Erreichung der von ihm beworbenen sozialen Merkmale verwendet, ist in der folgenden Tabelle dargestellt.

### ● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

| Indikator  | Teilfonds | Referenzwert |
|--|-----------|--------------|
| Nachhaltiger Gesundheits-Score – Kosteneinsparungen  | 0,29      | n. z.        |
| Nachhaltiger Gesundheits-Score – medizinische Outcomes   | 0,74      | n. z.        |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 0,00 %    | 0,00 %       |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 0,00 %    | 0,00 %       |

Die Daten in diesem regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung beziehen sich auf den Stand vom 31. März 2024, basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des am 31. März 2024 endenden Geschäftsjahres.

Referenzwert - MSCI World Health Care

### ● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

| Indikator  | Zeitraum zum  | Teilfonds | Referenzwert |
|--|---------------|-----------|--------------|
| Nachhaltiger Gesundheits-Score – Kosteneinsparungen  | 31. März 2024 | 0,29      | n. z.        |
|  | 31. März 2023 | 0,31      | n. z.        |
| Nachhaltiger Gesundheits-Score – medizinische Ergebnisse   | 31. März 2024 | 0,74      | n. z.        |
|  | 31. März 2023 | 0,84      | n. z.        |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 31. März 2024 | 0,00 %    | 0,00 %       |
|  | 31. März 2023 | 0,00 %    | 0,00 %       |

|  |                                |                  |                  |
|--|--------------------------------|------------------|------------------|
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen<br>(Antipersonenminen, Streumunition, chemische<br>und biologische Waffen) | 31. März 2024<br>31. März 2023 | 0,00 %<br>0,00 % | 0,00 %<br>0,00 % |
|--|--------------------------------|------------------|------------------|

Da es sich erst um den zweiten regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung handelt, ist kein Vergleich mit vorangegangenen Zeiträumen möglich.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die vom Teilfonds getätigten nachhaltigen Investitionen unterstützten soziale Ziele.

Der Teilfonds strebte eine langfristige Gesamtrendite an und investierte dazu in ein konzentriertes Portfolio von Aktien von Unternehmen, die von den weltweit zunehmend begrenzten Gesundheitsbudgets profitieren können, wobei er ESG-Merkmale im Sinne von Artikel 8 der Offenlegungsverordnung der Europäischen Union bewarb.

Der Teilfonds identifizierte und analysierte die wichtigsten Produkte oder Dienstleistungen von Unternehmen, die zur Reduzierung von Gesundheitskosten beitragen. Dies war integraler Bestandteil des Anlageentscheidungsprozesses, der darauf abzielte, negative soziale Auswirkungen durch eingeschränkten Zugang zu Gesundheitsversorgung zu minimieren und gleichzeitig die Renditen des Teilfonds zu steigern.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Wir bestätigen, dass wir nachhaltige Vermögenswerte darauf geprüft haben, ob sie erhebliche Beeinträchtigungen verursachen können. Dies erfolgte im Rahmen des Standard-Anlageprozesses von HSBC Asset Management (HSBC) und unter Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen.

*Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?*

Der Anlageberater hat alle durch die Offenlegungsverordnung definierten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI) auf ihre Relevanz für den Teilfonds geprüft. Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren legt fest, wie HSBC die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen identifiziert und darauf reagiert, und in welcher Form HSBC Nachhaltigkeitsrisiken berücksichtigt, die sich negativ auf Wertpapiere auswirken können, in die der Teilfonds investiert. HSBC identifizierte in Zusammenarbeit mit externen Screening-Dienstleistern wie Sustainalytics, ISS, MSCI und Trucost Unternehmen und Staaten mit schlechter Bilanz beim Management von ESG-Risiken, und wo solche wesentlichen Risiken identifiziert wurden, führte HSBC zusätzliche Due Diligence-Prüfungen durch. Durch Screening identifizierte Nachhaltigkeitsauswirkungen, einschließlich der relevanten PAI, bildeten einen Schlüsselfaktor beim Anlageentscheidungsprozess.

Die spezifischen PAI für diesen Teilfonds waren wie unten beschrieben.

Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren ist auf der Website [www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies](http://www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies) verfügbar.

*Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:*

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

HSBC hat sich der Anwendung und Förderung globaler Standards verpflichtet. Die wichtigsten Schwerpunktbereiche der Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren entsprachen den zehn UNGC-Grundsätzen. Diese Grundsätze stehen in Zusammenhang mit nicht finanziellen Risiken in den Bereichen Menschenrechte, Arbeit, Umweltschutz und Korruptionsbekämpfung. HSBC gehört darüber hinaus zu den Unterzeichnern der UN Principles for Responsible Investment. Diese bildeten den Rahmen für Ermittlung und Management von Nachhaltigkeitsrisiken beim Investmentansatz von HSBC. Von Unternehmen, in die der Teilfonds investierte, wurde erwartet, dass sie die Anforderungen des UNGC und der damit verbundenen Standards erfüllen. Unternehmen, die belegbar gegen einen der zehn Grundsätze des UNGC verstießen, wurden systematisch ausgeschlossen. Der Teilfonds führte verstärkte Due-Diligence-Prüfungen bei Unternehmen durch, die als nicht konform mit den Prinzipien des UNGC angesehen wurden oder die nach den unternehmenseigenen ESG Ratings von HSBC als risikoreich angesehen wurden. Darüber hinaus wurden die Unternehmen nach internationalen Standards wie den OECD-Leitsätzen bewertet.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen. Hierbei gelten spezifische von der Union definierte Kriterien.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*



### **Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Der Teilfonds berücksichtigte die folgenden PAI, indem er sie als Nachhaltigkeitsindikatoren beobachtete:

- Verstöße gegen die Prinzipien des UNGC und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD)
- Anteil der Investitionen mit Beteiligung an umstrittenen Waffen

Der Ansatz zur Berücksichtigung der PAI beinhaltete unter anderem, dass HSBC das Engagement der Unternehmen für den Übergang zu CO<sub>2</sub>-armen Wirtschaften, die zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern sowie die Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette prüfte, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails. Ebenfalls berücksichtigt wurde das Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit den Bereichen demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung. Das Screening führte dazu, dass HSBC nicht in bestimmte Unternehmen und Emittenten investierte.





## Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** Investitionen entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden: basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des Bezugszeitraums zum 31.03.2024

| Größte Investitionen                | Sektor           | % der Vermögenswerte | Land  |
|-------------------------------------|------------------|----------------------|---|
| Eli Lilly and Company               | Gesundheitswesen | 6,38 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| Novo Nordisk A/S Class B            | Gesundheitswesen | 4,99 %               | Dänemark  |
| UnitedHealth Group Incorporated     | Gesundheitswesen | 4,84 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| McKesson Corporation                | Gesundheitswesen | 4,08 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| Vertex Pharmaceuticals Incorporated | Gesundheitswesen | 3,97 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| Tenet Healthcare Corporation        | Gesundheitswesen | 3,54 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| Boston Scientific Corporation       | Gesundheitswesen | 3,43 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| Neurocrine Biosciences, Inc.        | Gesundheitswesen | 3,41 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| DexCom, Inc.                        | Gesundheitswesen | 3,14 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| Elevance Health, Inc.               | Gesundheitswesen | 2,99 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| Regeneron Pharmaceuticals, Inc.     | Gesundheitswesen | 2,91 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| argenx SE ADR                       | Gesundheitswesen | 2,69 %               | Niederlande   |
| AstraZeneca PLC                     | Gesundheitswesen | 2,63 %               | Vereinigtes Königreich von Großbritannien und Nordirland. |
| United Therapeutics Corporation     | Gesundheitswesen | 2,58 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |

Barmittel und Derivate wurden nicht berücksichtigt

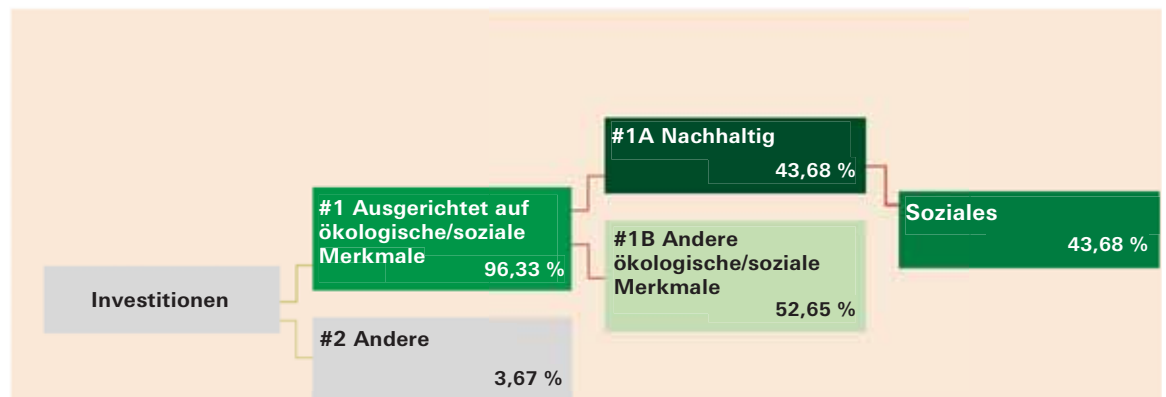


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

43,68 % des Portfolios waren in nachhaltige Vermögenswerte investiert.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?



**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**#2 Andere Investitionen** umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

## In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

| Sektor / Teilsektor    | % der Vermögenswerte |
|------------------------|----------------------|
| Gesundheitswesen       | 95,79 %              |
| Barmittel und Derivate | 2,97 %               |
| Basiskonsumgüter       | 1,24 %               |
| Summe                  | 100,00 %             |

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.



## Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

Der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen lag bei 0 %. Der Teilfonds hat sich nicht verpflichtet, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen.

## Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

Ja:
  In fossiles Gas
  In Kernenergie

Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

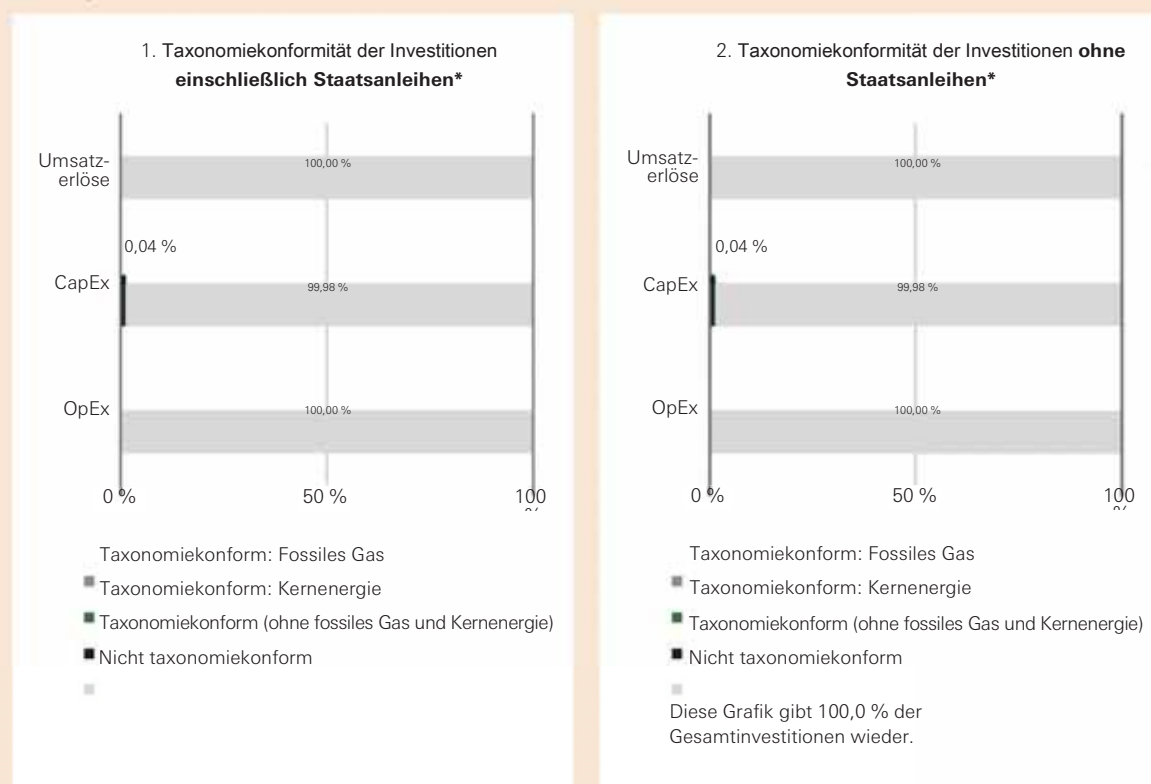
Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- Umsatzerlöse, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

**Übergangstätigkeiten** sind Wirtschaftstätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemission swerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

**Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.**



\* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

**Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Im Referenzzeitraum betrug der Anteil der Investitionen des Fonds, die in Übergangstätigkeiten geflossen sind, 0,00 % und der Anteil der Investitionen, die in ermöglichende Tätigkeiten geflossen ist, 0,00 %.

**Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

| Indikator   | 2023-2024 | 2022-2023 |
|---|-----------|-----------|
| Umsatz – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                       | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform: Kernenergie                        | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie) | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Nicht taxonomiekonform                               | 100,00 %  | 100,00 %  |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                        | n. z.     | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                         | n. z.     | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)  | 0,04 %    | 0,00 %    |
| CAPEX – Nicht taxonomiekonform                                | 99,98 %   | 100,00 %  |
| OPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                         | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                          | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)   | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Nicht taxonomiekonform                                 | 100,00 %  | 100,00 %  |

Da es sich erst um den zweiten Berichtszeitraum des Teilfonds handelt, ist ein Vergleich mit der Zeit davor nicht erforderlich.



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?**

Die nachhaltigen Investitionen mit einem nicht mit der EU-Taxonomie konformen Umweltziel wurden mit 0 % bewertet, da der Teilfonds ein soziales Ziel verfolgt.



### **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Teilfonds tätigte sozial nachhaltige Investitionen in Höhe von 43,68 %.



### **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

#2 Andere Investitionen umfasst die Finanzinstrumente, die nicht auf soziale Merkmale des Teilfonds ausgerichtet sind und nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden. In manchen Fällen ist dies auf die Nichtverfügbarkeit von Daten und Unternehmensmaßnahmen zurückzuführen. Diese Positionen unterlagen nach wie vor dem vollständigen Ausschluss-Screening von HSBC und wurden im Hinblick auf verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Prinzipien des UNGC und der OECD geprüft.

Der Teilfonds hielt Barmittel / Barmitteläquivalente (der Prozentsatz der gehaltenen Barmittel ist in der obigen Tabelle der Sektoren/Teilektoren unter der Überschrift „In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?“ ersichtlich) zum Zwecke des Liquiditätsmanagements sowie derivative Finanzinstrumente zum Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements. Barmittel / Barmitteläquivalente und derivative Finanzinstrumente verfügen aufgrund der Art dieser Instrumente über keinen ökologischen oder sozialen Mindestschutz.



### **Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?**

Der Kern unseres Verfahrens bestand darin, Unternehmen zu identifizieren, die Produkte/Dienstleistungen anbieten, die dazu beitragen, die Gesamtkosten der Pflege zu senken und gleichzeitig bessere klinische Ergebnisse für die Patienten zu erzielen. Im Rahmen dieses Verfahrens haben wir uns mit der Erschwinglichkeit der Pflege befasst, die die größte Herausforderung darstellt und die Tauglichkeit der Gesundheitsversorgung gefährdet. Die mangelnde Erschwinglichkeit der Gesundheitsversorgung wirkt sich negativ auf die Patienten aus und beeinträchtigt auch die Umsätze des Unternehmens, wenn weniger oder keine Produkte verkauft werden. Das Hauptelement unseres Prozesses war unser firmeneigener Nachhaltigkeitsindex zur Bewertung der Erschwinglichkeit. Das Verfahren wurde durch eine traditionellere Bewertung der Unternehmen aus finanzieller, regulatorischer, klinischer, produktbezogener und abschließender Sicht ergänzt.

Der erste Faktor war der Nachhaltigkeitsindex, der die Fähigkeit der Unternehmen bewertete, auf den Wandel der Kundenbedürfnisse einzugehen. Er bezog sich auf den kombinierten Bedarf an verbesserten klinischen Ergebnissen und Erschwinglichkeit/Kosteneinsparungen. Zur Bewertung der klinischen Differenzierung, d. h. der Frage, wie viel besser oder schlechter ein Produkt oder eine Dienstleistung im Vergleich zu dem ist, was derzeit oder alternativ verwendet wird, unterteilen wir die klinische Differenzierung in sechs verschiedene Attribute: Klinische Ergebnisse, Beginn, Dauer, Sicherheit, Bequemlichkeit und von Patienten angegebene Ergebnisse.

Die Relevanz und Bedeutung der einzelnen Attribute variierte je nach Krankheit, Indikation oder Umfeld, in dem ein Produkt oder eine Dienstleistung eingesetzt wurde. Auf der Grundlage der Relevanz der einzelnen Attribute in einem bestimmten Umfeld nahm der Anlageberater unter Anwendung seines Fachwissens die Gewichtungen vor. Anschließend wurde jedes relevante Attribut auf einer Skala von -3 bis +3 bewertet, wobei 0 als gleichwertig mit dem derzeitigen Verfahren, +1/-1 als leicht besser/schlechter, +2/-2 als besser/schlechter und +3/-3 als deutlich besser/schlechter eingestuft wurde. Die veröffentlichte klinische und wissenschaftliche Literatur diente als Grundlage für die Bewertungen, und der Anlageberater stützte sich bei der Festlegung der Bewertungen auf sein Fachwissen. Der Gesamt-Score für die klinische Differenzierung eines Produkts / einer Dienstleistung wurde anhand eines gewichteten Durchschnitts der Attribut-Scores berechnet. Wurden mehrere Produkte zur Bewertung eines Unternehmens herangezogen, wurde der Score für die klinische Differenzierung für jedes Produkt / jede Dienstleistung anhand seines/ihres gegenwärtigen Nettoumsatzbeitrags gewichtet.

Der zweite Faktor waren Kostenersparnisse: d. h. wie viel ein Produkt oder eine Dienstleistung im Vergleich zu dem derzeit verwendeten oder alternativ verwendeten Produkt oder der Dienstleistung an Kosten einspart oder zusätzlich verursacht. Wir haben Kosteneinsparungen vier verschiedenen Attributen zugewiesen: Kosteneffizienz, Kostenausgleich, Preis und Volumen. Es wurden veröffentlichte gesundheitsökonomische Daten und zusätzliche Informationen aus der Kommunikation mit dem Unternehmen als Grundlage für die Ratings verwendet. Jedes Attribut wurde auf einer Skala von -3 bis +3 bewertet, wobei 0 den Kosten der derzeitigen Behandlung/Dienstleistung entspricht und +1/-1 leicht besser/schlechter, +2/-2 besser/schlechter und +3/-3 deutlich besser/schlechter eingestuft wurde.

Der Gesamt-Score für eine Kosteneinsparung eines Produkts / einer Dienstleistung wurde anhand eines gewichteten Durchschnitts eines jeden Attribut-Scores berechnet, gewichtet nach der Relevanz eines jeden Attributs. Wurden mehrere Produkte zur Bewertung eines Unternehmens herangezogen, wurde der Score für die Kosteneinsparung für jedes Produkt / jede Dienstleistung anhand seines/ihres gegenwärtigen Nettoumsatzbeitrags gewichtet.

Ein Unternehmen wurde gemäß unserem Nachhaltigkeitsindex als nachhaltig eingestuft, wenn es sowohl bei der klinischen Differenzierung als auch bei den Kosteneinsparungen neutral bis positiv, d. h. mit 0 bis +3 bewertet wurde. In anderen Worten: Diese Unternehmen haben ein Wertversprechen, das klinisch und wirtschaftlich gleichwertig oder besser ist als Alternativen, und daher gute Chancen auf eine positive Dreifachwirkung für die Patienten, die Kostenträger und die Gesundheitsdienstleister.

## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend.

### ● **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Nicht zutreffend.

### ● **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?**

Nicht zutreffend.

### ● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

### ● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.



Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Name des Produkts: HSBC GLOBAL INVESTMENT FUNDS - GLOBAL INFRASTRUCTURE EQUITY

Unternehmenskennung (LEI-Code): 213800K1VMUUC6XW4441

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen 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?

| ●● <input type="checkbox"/> Ja   | ●○ <input checked="" type="checkbox"/> Nein   |
|--|---|
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel</b> getätigt: _ %<br><br><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><br><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit <b>ökologische/soziale Merkmale beworben</b> und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 21,50 % an nachhaltigen Investitionen<br><br><input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><br><input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><br><input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel |
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel</b> getätigt: _ %  | <input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine <b>nachhaltigen Investitionen getätigt</b>   |



### Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Während des Geschäftsjahres zum 31. März 2024 (der Bezugszeitraum) bewarb der Teilfonds die folgenden Merkmale:

1. Es wurde auf das Erreichen eines ESG-Score des Teilfonds hingearbeitet, der über dem vom Teilfonds ausgewählten Referenzindex liegt (ein höherer Score als der Referenzwert bedeutet bessere ESG-Referenzen).
2. Der Teilfonds prüfte und analysierte alle Unternehmen oder Emittenten im Hinblick auf ökologische Merkmale, insbesondere physische Risiken durch den Klimawandel und Personalmanagement. Für die zugrunde liegenden E-, S- und G-Säulen wurden ein Screening sowie ein Vergleich mit dem für den Teilfonds definierten Referenzwert durchgeführt. „E“ und „S“ spiegeln die einzelnen Elemente der vom Teilfonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale wider, „G“ die Unternehmensführungspraktiken, die die Interessen von Minderheitsaktionären schützen und eine langfristige nachhaltige Wertschöpfung fördern.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

3. Der Teilfonds berücksichtigte verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Grundsätzen des Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC) und den Leitsätzen für multinationale Unternehmen der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für Unternehmen.
4. Der Teilfonds schloss Geschäftstätigkeiten aus, die als umweltschädlich gelten, wie z. B. die Förderung von Kraftwerkskohle und die Kohleverstromung.
5. Der Teilfonds berücksichtigte aktiv ökologische und soziale Aspekte, indem er über unsere Engagement- und Stewardship-Teams Mitwirkung bei Emittenten umsetzte und sein Recht zur Stimmrechtsvertretung wahrnahm.
6. Der Teilfonds schloss nach entsprechender Analyse Anlagen in umstrittenen Waffen aus.

Der ESG-Score wird von Drittanbietern von ESG-Daten übernommen. Die Berücksichtigung einzelner (in der nachstehenden Tabelle nummerierter) wichtigster nachteiliger Indikatoren (PAI) drückt sich darin aus, dass der Teilfonds niedrigere Werte als der Referenzwert aufweist. Die bei der Berechnung der PAI-Werte verwendeten Daten stammen von externen Datenanbietern. Sie können auf Unternehmensangaben basieren oder von den Datenanbietern geschätzt werden wo keine solchen Angaben vorliegen. Bitte beachten Sie, dass es nicht immer möglich ist, die Richtigkeit, Aktualität oder Vollständigkeit der von Drittanbietern bereitgestellten Daten zu garantieren.

Der Teilfonds wurde aktiv verwaltet und bildete keinen Referenzwert nach. Der Referenzwert diente zum Vergleich des Teilfonds mit dem allgemeinen Markt, nicht jedoch der Erreichung der vom Teilfonds beworbenen ökologischen Merkmale. Das Abschneiden der Nachhaltigkeitsindikatoren, die der Teilfonds zur Messung der Erreichung der von ihm beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet, ist in der folgenden Tabelle dargestellt.

Alle Unternehmen haben eine gute Unternehmensführung bewiesen, was sich am PAI-Score 10 unten ablesen lässt.

### **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

| <b>Indikator</b>   | <b>Teilfonds</b> | <b>Referenzwert</b> |
|--|------------------|---------------------|
| ESG-Score  | 7,73             | 7,02                |
| 1. THG-Emissionen – Tonnen CO2-Äquivalente   | 68.755,01        | 1.031.256.894,87    |
| 2. CO2-Fußabdruck – Tonnen CO2 pro Million Euro (EVIC)   | 101,61           | 239,70              |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO2-Äquivalente pro Million Euro Umsatz  | 396,72           | 897,70              |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 0,00 %           | 0,15 %              |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 0,00 %           | 0,00 %              |

Die Daten in diesem regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung beziehen sich auf den Stand vom 31. März 2024, basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des am 31. März 2024 endenden Geschäftsjahres.

Referenzwert - HGIF Global Infrastructure Equity Investment Universe

### ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

| Indikator  | Zeitraum zum  | Teilfonds | Referenzwert     |
|--|---------------|-----------|------------------|
| ESG-Score  | 31. März 2024 | 7,73      | 7,02             |
|  | 31. März 2023 | 7,07      | 6,93             |
| 1. THG-Emissionen – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente  | 31. März 2024 | 68.755,01 | 1.031.256.894,87 |
|  | 31. März 2023 | 58.962,73 | 382,13           |
| 2. CO <sub>2</sub> -Fußabdruck – Tonnen CO <sub>2</sub> pro Million Euro (EVIC)  | 31. März 2024 | 101,61    | 239,70           |
|  | 31. März 2023 | 97,94     | 186,54           |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente pro Million Euro Umsatz   | 31. März 2024 | 396,72    | 897,70           |
|  | 31. März 2023 | 459,20    | 681,35           |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 31. März 2024 | 0,00 %    | 0,15 %           |
|  | 31. März 2023 | 0,00 %    | 0,30 %           |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 31. März 2024 | 0,00 %    | 0,00 %           |
|  | 31. März 2023 | 0,00 %    | 0,00 %           |

Da es sich erst um den zweiten regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung handelt, ist kein Vergleich mit vorangegangenen Zeiträumen möglich.

### **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Der Teilfonds hat kein nachhaltiges Investitionsziel und hat sich nicht verpflichtet, nachhaltige Investitionen im Sinne der Offenlegungsverordnung zu tätigen. Der Teilfonds bewirbt ökologische Merkmale, und als Ergebnis des Anlageverfahrens investierte der Teilfonds in einen Anteil nachhaltiger Investitionen, die auf die vom Teilfonds beworbenen ökologischen Merkmale abgestimmt waren.

### **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Wir bestätigen, dass wir nachhaltige Vermögenswerte darauf geprüft haben, ob sie erhebliche Beeinträchtigungen verursachen können. Dies erfolgte im Rahmen des Standard-Anlageprozesses von HSBC Asset Management (HSBC) und unter Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen.

*Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?*

Der Anlageberater hat alle durch die Offenlegungsverordnung definierten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI) auf ihre Relevanz für den Teilfonds geprüft. Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren legt fest, wie HSBC die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen identifiziert und darauf reagiert, und in welcher Form HSBC Nachhaltigkeitsrisiken berücksichtigt, die sich negativ auf Wertpapiere auswirken können, in die der Teilfonds investiert. HSBC identifizierte in Zusammenarbeit mit externen Screening-Dienstleistern wie Sustainalytics, ISS, MSCI und Trucost Unternehmen und Staaten mit schlechter Bilanz beim Management von ESG-Risiken, und wo solche wesentlichen Risiken identifiziert wurden, führte HSBC zusätzliche Due Diligence-Prüfungen durch. Durch Screening identifizierte Nachhaltigkeitsauswirkungen, einschließlich der relevanten PAI, bildeten einen Schlüsselfaktor beim Anlageentscheidungsprozess.

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 oben beschriebene Ansatz führte dazu, dass unter anderem folgende Faktoren geprüft wurden:

- Engagement der Unternehmen für den Übergang zu CO<sub>2</sub>-armen Wirtschaften, zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern, Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus großen Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails; und
- Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit folgenden Bereichen: demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.

Die spezifischen PAI für diesen Teilfonds waren wie unten beschrieben.

Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren ist auf der Website [www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies](http://www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies) verfügbar.

*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:*

HSBC hat sich der Anwendung und Förderung globaler Standards verpflichtet. Die wichtigsten Schwerpunktbereiche der Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren entsprachen den zehn UNGC-Grundsätzen. Diese Grundsätze stehen in Zusammenhang mit nicht finanziellen Risiken in den Bereichen Menschenrechte, Arbeit, Umweltschutz und Korruptionsbekämpfung. HSBC gehört darüber hinaus zu den Unterzeichnern der UN Principles for Responsible Investment. Diese bildeten den Rahmen für Ermittlung und Management von Nachhaltigkeitsrisiken beim Investmentansatz von HSBC. Von Unternehmen, in die der Teilfonds investierte, wurde erwartet, dass sie die Anforderungen des UNGC und der damit verbundenen Standards erfüllen. Unternehmen, die belegbar gegen einen der zehn Grundsätze des UNGC verstießen, wurden systematisch ausgeschlossen. Der Teilfonds führte verstärkte Due-Diligence-Prüfungen bei Unternehmen durch, die als nicht konform mit den Prinzipien des UNGC angesehen wurden oder die nach den unternehmenseigenen ESG Ratings von HSBC als risikoreich angesehen wurden. Darüber hinaus wurden die Unternehmen nach internationalen Standards wie den OECD-Leitsätzen bewertet.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen. Hierbei gelten spezifische von der Union definierte Kriterien.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*



## Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die von diesem Teilfonds berücksichtigten PAI waren:

- Treibhausgasemissionen (Scope 1 und Scope 2)
- CO<sub>2</sub>-Fußabdruck (Scope 1 und Scope 2)
- Treibhausgasintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1 und Scope 2)
- Verstöße gegen die Prinzipien des UNGC und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD)
- Anteil der Investitionen mit Beteiligung an umstrittenen Waffen

Der Ansatz zur Berücksichtigung der PAI beinhaltete unter anderem, dass HSBC das Engagement der Unternehmen für den Übergang zu CO<sub>2</sub>-armen Wirtschaften, die zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern sowie die Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette prüfte, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails. Ebenfalls berücksichtigt wurde das Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit den Bereichen demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung. Ausgeschlossen waren auch Unternehmen, deren Geschäftsaktivitäten als umweltschädlich eingestuft wurden.

Das Screening führte dazu, dass HSBC nicht in bestimmte Unternehmen und Emittenten investierte.



## Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der Investitionen** entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden: basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des Bezugszeitraums zum 31.03.2024 bis 31.03.2023

| Größte Investitionen         | Sektor                         | % der Vermögenswerte | Land  |
|------------------------------|--------------------------------|----------------------|---|
| American Tower Corporation   | Immobilien                     | 6,13 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| Williams Companies, Inc.     | Energie                        | 5,25 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| Cellnex Telecom S.A.         | Kommunikationsdienstleistungen | 4,45 %               | Spanien   |
| National Grid plc            | Versorger                      | 4,43 %               | Vereinigtes Königreich von Großbritannien und Nordirland. |
| Crown Castle Inc.            | Immobilien                     | 4,35 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| Sempra                       | Versorger                      | 4,34 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| Pembina Pipeline Corporation | Energie                        | 4,30 %               | Kanada  |
| Cheniere Energy, Inc.        | Energie                        | 4,25 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| Edison International         | Versorger                      | 3,80 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |
| Eiffage SA                   | Industriegüter                 | 3,41 %               | Frankreich  |
| Royal Vopak NV               | Energie                        | 3,30 %               | Niederlande   |
| Eversource Energy            | Versorger                      | 3,23 %               | Vereinigte Staaten von Amerika                            |

Barmittel und Derivate wurden nicht berücksichtigt

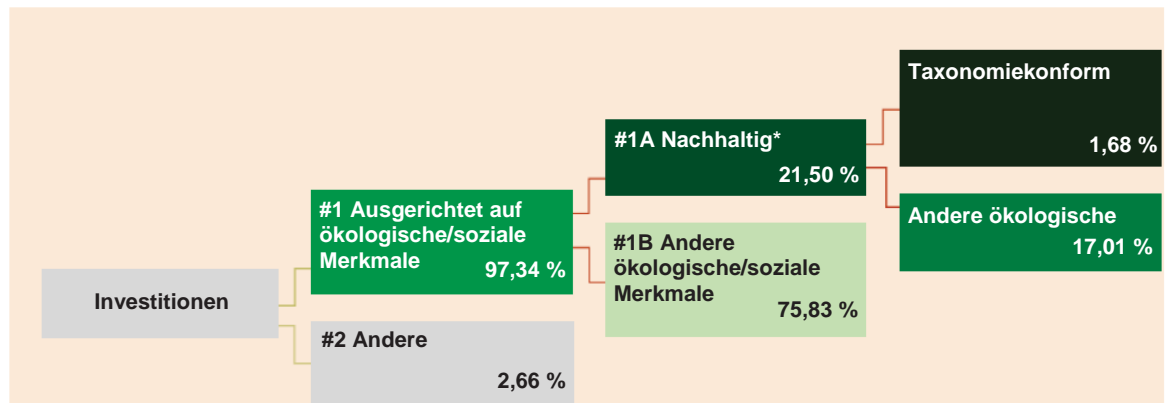


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

21,50 % des Portfolios waren in nachhaltige Vermögenswerte investiert.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?



**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**#2 Andere Investitionen** umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

\* Ein Unternehmen oder Emittent, das bzw. der als nachhaltige Investition angesehen wird, kann sowohl zu einem sozialen als auch zu einem ökologischen Ziel beitragen, das an der EU-Taxonomie ausgerichtet sein kann oder nicht. Die Zahlen in der obigen Grafik berücksichtigen dies. Jedoch darf eine Gesellschaft oder ein Emittent unter dem Punkt der nachhaltigen Investitionen (#1A Nachhaltige Investitionen) nur einmal erfasst werden.

Die Prozentzahlen von taxonomiekonformen Investitionen und Andere ökologische Merkmale stimmen aufgrund der unterschiedlichen Berechnungsmethoden für nachhaltige Investitionen und taxonomiekonforme Investitionen nicht mit #1A Nachhaltige Investitionen überein.

### In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

| Sektor / Teilsektor                   | % der Vermögenswerte |
|---------------------------------------|----------------------|
| Versorger                             | 34,19 %              |
| Stromversorgungsbetriebe              | 10,26 %              |
| Erdgas                                | 7,90 %               |
| Multi-Versorger                       | 14,76 %              |
| Energie                               | 29,61 %              |
| Lagerung und Transport von Öl und Gas | 29,61 %              |
| Industriegüter                        | 16,26 %              |
| Immobilien                            | 10,30 %              |
| Kommunikationsdienstleistungen        | 9,22 %               |
| Barmittel und Derivate                | 0,40 %               |
| Summe                                 | 100,00 %             |



## Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

Der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen ist in den obigen Feldern zur Vermögensallokation ersichtlich.

### Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

Ja:

In fossiles Gas  In Kernenergie

Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

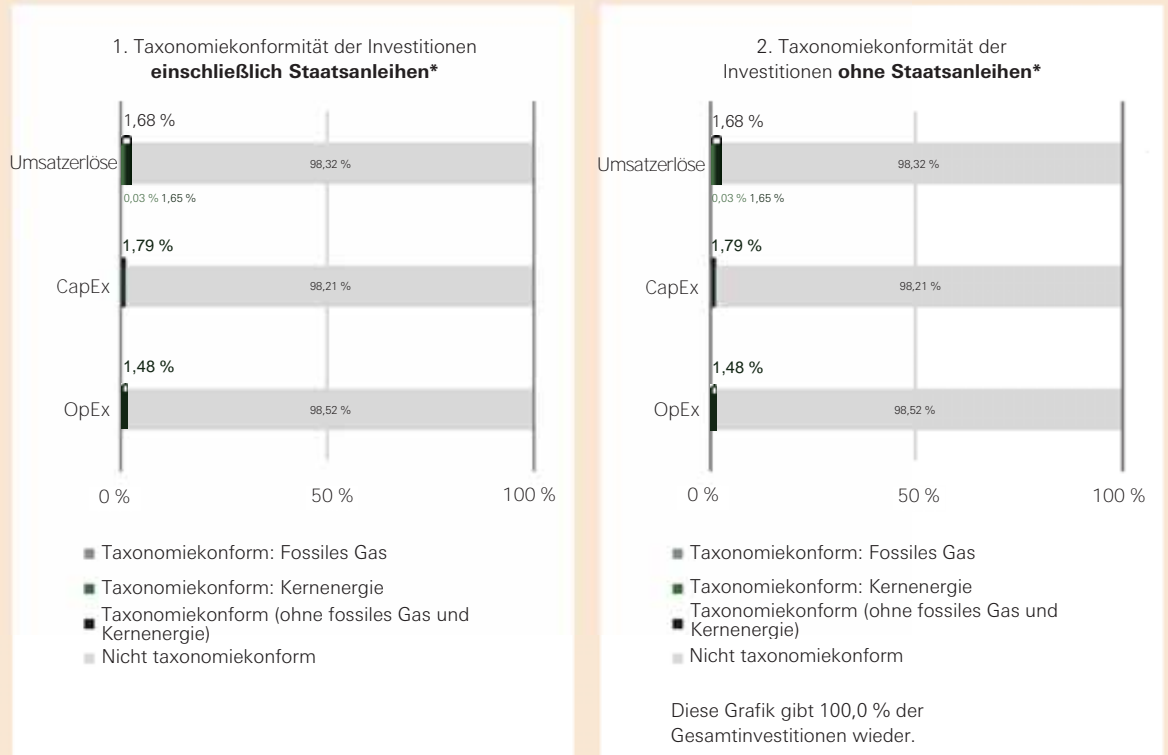
- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen.

- **Betriebsausgaben**

**Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

**Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.**



\* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

### Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?


Im Referenzzeitraum betrug der Anteil der Investitionen des Fonds, die in Übergangstätigkeiten geflossen sind, 0,00 % und der Anteil der Investitionen, die in ermöglichende Tätigkeiten geflossen ist, 0,99 %.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

| Indikator   | 2023-2024 | 2022-2023 |
|---|-----------|-----------|
| Umsatz – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                       | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform: Kernenergie                        | 0,03 %    | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie) | 1,65 %    | 0,00 %    |
| Umsatz – Nicht taxonomiekonform                               | 98,32 %   | 100,00 %  |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                        | n. z.     | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                         | n. z.     | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)  | 1,79 %    | 0,00 %    |
| CAPEX – Nicht taxonomiekonform                                | 98,21 %   | 100,00 %  |
| OPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                         | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                          | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)   | 1,48 %    | 0,00 %    |
| OPEX – Nicht taxonomiekonform                                 | 98,52 %   | 100,00 %  |

Da es sich erst um den zweiten Berichtszeitraum des Teilfonds handelt, ist ein Vergleich mit der Zeit davor nicht erforderlich.

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeit en 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?**

Der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel war 17,01 %. Der Teilfonds hat sich nicht verpflichtet, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen.

 **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Teilfonds investierte nicht in sozial nachhaltige Anlagen.

 **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

#2 Andere Investitionen umfasst die Finanzinstrumente, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden. In manchen Fällen ist dies auf die Nichtverfügbarkeit von Daten und Unternehmensmaßnahmen zurückzuführen. Diese Positionen unterlagen nach wie vor dem vollständigen Ausschluss-Screening von HSBC und wurden im Hinblick auf verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Prinzipien des UNGC und der OECD geprüft.

Der Teilfonds hielt Barmittel / Barmitteläquivalente (der Prozentsatz der gehaltenen Barmittel ist in der obigen Tabelle der Sektoren/Teilsektoren unter der Überschrift „In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?“ ersichtlich) zum Zwecke des Liquiditätsmanagements sowie derivative Finanzinstrumente zum Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements. Barmittel / Barmitteläquivalente und derivative Finanzinstrumente verfügen aufgrund der Art dieser Instrumente über keinen ökologischen oder sozialen Mindestschutz.

 **Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?**

Im Laufe des Berichtszeitraums schloss der Anlageberater unter anderem verbotene Waffen, umstrittene Waffen, Unternehmen, die mehr als 10 % ihres Umsatzes aus Kraftwerkskohle und Energieerzeugung aus Kohle generieren, und Tabakherstellung aus und investierte in Unternehmen mit verantwortungsvollen Geschäftspraktiken gemäß den Prinzipien des UNGC.

Der Teilfonds identifizierte und analysierte die ESG-Referenzen von Unternehmen als wesentlichen Bestandteil des Anlageentscheidungsprozesses. Die ESG-Referenzen stammen aus verschiedenen firmeneigenen Quellen von HSBC und von Drittanbietern, unterliegen kontinuierlichem Research und können sich im Laufe der Zeit ändern, wenn neue Referenzen identifiziert werden. Diese umfassen insbesondere:

- ökologische und soziale Faktoren, insbesondere die physischen Risiken des Klimawandels und des Personalmanagements, die erhebliche Auswirkungen auf die finanzielle Performance und die Bewertung eines Wertpapieremittenten haben können
- Im Rahmen des Anlageentscheidungsprozesses werden ESG-Referenzen auf vielfältige Weise integriert:
- Mindestens 25 % der Qualitätsbewertung eines infrastrukturnahen Wertpapiers werden ESG-Referenzen zugerechnet
- Ausgenommen sind Unternehmen mit einem niedrigen ESG-Score und Unternehmen, die als nicht konform mit den Prinzipien des UNGC angesehen werden. Dieser Ausschluss liegt im Ermessen des Anlageberaters. In Unternehmen mit einem sich verbessernden, aber immer noch niedrigen ESG-Score und in Unternehmen mit einer erkennbaren Richtung hin zur Einhaltung der Prinzipien des UNGC kann weiterhin investiert werden
- Zusammenarbeit mit Unternehmen im Bereich Energiewende und ESG-Vorschriften

Die wichtigsten Maßnahmen während des Berichtszeitraums waren die Steigerung des Engagements in zwei Unternehmen, die beide relativ hohe ESG-Scores aufweisen, was im obigen ESG-Score der Teilfonds ersichtlich ist. Außerdem wurden die Positionen in zwei kohlenstoffintensiven Unternehmen im Berichtszeitraum reduziert, was sich in der oben beschriebenen Verringerung des PAI 3-Scores der Teilfonds widerspiegelt.



### **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

- ***Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?***

Nicht zutreffend.

- ***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?***

Nicht zutreffend.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?***

Nicht zutreffend.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?***

Nicht zutreffend.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen 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.

Name des Produkts: HSBC GLOBAL INVESTMENT FUNDS - GLOBAL LOWER CARBON EQUITY

Unternehmenskennung (LEI-Code): 213800ENBN1SRILVHQ60

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

| Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?  |   |
|--|---|
| <input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> <input type="checkbox"/> <b>Ja</b>   | <input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> <b>Nein</b>  |
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel</b> getätigt: _ %<br><br><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><br><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit <b>ökologische/soziale Merkmale beworben</b> und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 37,38 % an nachhaltigen Investitionen<br><br><input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><br><input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><br><input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel |
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel</b> getätigt: _ %  | <input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber <b>keine nachhaltigen Investitionen getätigt</b>   |



### Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Während des Geschäftsjahres zum 31. März 2024 (der Bezugszeitraum) bewarb der Teilfonds die folgenden Merkmale:

- Der Teilfonds berücksichtigte aktiv Investitionen mit geringer Kohlenstoffintensität, und der ESG-Score wurde so gestaltet, dass er im Vergleich zum Index einen höheren Wert aufweist.
- Der Teilfonds berücksichtigte verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Grundsätzen des Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC) und den Leitsätzen für multinationale Unternehmen der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für Unternehmen.
- Der Teilfonds schloss als umweltschädlich eingestufte Geschäftsaktivitäten aus, wie Kraftwerkskohle und Energieerzeugung aus Kohle.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

4. Der Teilfonds prüfte und analysierte alle Unternehmen oder Emittenten im Hinblick auf ökologische Merkmale, insbesondere physische Risiken durch den Klimawandel und Personalmanagement. Für die zugrunde liegenden E-, S- und G-Säulen wurden ein Screening sowie ein Vergleich mit dem für den Teilfonds definierten Referenzwert durchgeführt. „E“ und „S“ spiegeln die einzelnen Elemente der vom Teilfonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale wider, „G“ die Unternehmensführungspraktiken, die die Interessen von Minderheitsaktionären schützen und eine langfristige nachhaltige Wertschöpfung fördern.
5. Der Teilfonds berücksichtigte aktiv ökologische und soziale Aspekte, indem er über unsere Engagement- und Stewardship-Teams Mitwirkung bei Emittenten umsetzte und sein Recht zur Stimmrechtsvertretung wahrnahm.
6. Der Teilfonds schloss Anlagen in umstrittenen Waffen aus.

Der ESG-Score wird von einem Drittanbieter von ESG-Daten übernommen. MSCI. Die Berücksichtigung einzelner (in der nachstehenden Tabelle nummerierter) wichtigster nachteiliger Indikatoren (PAI) drückt sich darin aus, dass der Teilfonds niedrigere Werte als der Referenzwert aufweist. Die bei der Berechnung der PAI-Werte verwendeten Daten stammen von externen Datenanbietern. Sie können auf Unternehmensangaben basieren oder von den Datenanbietern geschätzt werden, wo keine solchen Angaben vorliegen. Bitte beachten Sie, dass es nicht immer möglich ist, die Richtigkeit, Aktualität oder Vollständigkeit der von Drittanbietern bereitgestellten Daten zu garantieren.

Der Referenzwert wurde zur Messung der Kohlenstoffintensität und Festlegung der ESG-Scores herangezogen, diente aber nicht der Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale des Teilfonds.

Das Abschneiden der Nachhaltigkeitsindikatoren, die der Teilfonds zur Messung der Erreichung der von ihm beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet, ist in der folgenden Tabelle dargestellt. Alle Unternehmen haben eine gute Unternehmensführung bewiesen, was sich am PAI-Score 10 unten ablesen lässt.

### **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

| <b>Indikator</b>   | <b>Teilfonds</b> | <b>Referenzwert</b> |
|--|------------------|---------------------|
| ESG-Score  | 8,25             | 6,87                |
| Gewichteter Score der Säule „E“  | 1,25             | 1,22                |
| Gewichteter Score der Säule „S“  | 2,49             | 2,11                |
| Gewichteter Score der Säule „G“  | 2,35             | 2,19                |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO2-Äquivalente pro Million Euro Umsatz  | 54,03            | 109,67              |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 0,00 %           | 0,69 %              |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 0,00 %           | 0,24 %              |

Die Daten in diesem regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung beziehen sich auf den Stand vom 31. März 2024, basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des am 31. März 2024 endenden Geschäftsjahres.

Referenzwert – MSCI World



## ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

| Indikator  | Zeitraum zum  | Teilfonds | Referenzwert |
|--|---------------|-----------|--------------|
| ESG-Score  | 31. März 2024 | 8,25      | 6,87         |
|  | 31. März 2023 | 8,37      | 6,94         |
| Gewichteter Score der Säule „E“  | 31. März 2024 | 1,25      | 1,22         |
|  | 31. März 2023 | 2,54      | 1,22         |
| Gewichteter Score der Säule „S“  | 31. März 2024 | 2,49      | 2,11         |
|  | 31. März 2023 | 2,54      | 2,14         |
| Gewichteter Score der Säule „G“  | 31. März 2024 | 2,35      | 2,19         |
|  | 31. März 2023 | 2,34      | 2,19         |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente pro Million Euro Umsatz   | 31. März 2024 | 54,03     | 109,67       |
|  | 31. März 2023 | 66,00     | 144,58       |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 31. März 2024 | 0,00 %    | 0,69 %       |
|  | 31. März 2023 | 0,00 %    | 0,80 %       |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 31. März 2024 | 0,00 %    | 0,24 %       |
|  | 31. März 2023 | 0,00 %    | 0,00 %       |

Ab November 2023 wurden diesem Teilfonds PAI 1 – Treibhausgasemissionen und PAI 2 – CO<sub>2</sub>-Fußabdruck fälschlicherweise als Nachhaltigkeitsindikatoren zugewiesen und im Januar 2024 wieder entfernt. Daher haben wir über diese PAI nicht berichtet.

### **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die vom Teilfonds getätigten nachhaltigen Investitionen trugen zu den Umweltzielen bei, zu denen unter anderem die Verringerung der Treibhausgasemissionen und des CO<sub>2</sub>-Fußabdrucks gehören.

Die Portfoliokonstruktion des Teilfonds zielte auf ein geringeres Engagement in kohlenstoffintensiven Unternehmen und einen besseren Gesamt-ESG-Score als der Referenzwert ab.

### **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Wir bestätigen, dass wir nachhaltige Vermögenswerte darauf geprüft haben, ob sie erhebliche Beeinträchtigungen verursachen können. Dies erfolgte im Rahmen des Standard-Anlageprozesses von HSBC Asset Management (HSBC) und unter Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen.

*Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?*

Der Anlageberater hat alle durch die Offenlegungsverordnung definierten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI) auf ihre Relevanz für den Teilfonds geprüft. Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren legt fest, wie HSBC die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen identifiziert und darauf reagiert, und in welcher Form HSBC Nachhaltigkeitsrisiken berücksichtigt, die sich negativ auf Wertpapiere auswirken können, in die der Teilfonds investiert. HSBC identifizierte in Zusammenarbeit mit externen Screening-Dienstleistern wie Sustainalytics, ISS, MSCI und Trucost Unternehmen und Staaten mit schlechter Bilanz beim Management von ESG-Risiken, und wo solche wesentlichen Risiken identifiziert wurden, führte HSBC zusätzliche Due Diligence-Prüfungen durch. Durch Screening identifizierte Nachhaltigkeitsauswirkungen, einschließlich der relevanten PAI, bildeten einen Schlüsselfaktor beim Anlageentscheidungsprozess.

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 oben beschriebene Ansatz führte dazu, dass unter anderem folgende Faktoren geprüft wurden:

- Engagement der Unternehmen für den Übergang zu CO2-armen Wirtschaften, zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern, Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus großen Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails; und
- Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit folgenden Bereichen: demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.

Die spezifischen PAI für diesen Teilfonds waren wie unten beschrieben.

Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren ist auf der Website [www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies](http://www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies) verfügbar.

*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:*

HSBC hat sich der Anwendung und Förderung globaler Standards verpflichtet. Die wichtigsten Schwerpunktbereiche der Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren entsprachen den zehn UNGC-Grundsätzen. Diese Grundsätze stehen in Zusammenhang mit nicht finanziellen Risiken in den Bereichen Menschenrechte, Arbeit, Umweltschutz und Korruptionsbekämpfung. HSBC gehört darüber hinaus zu den Unterzeichnern der UN Principles for Responsible Investment. Diese bildeten den Rahmen für Ermittlung und Management von Nachhaltigkeitsrisiken beim Investmentansatz von HSBC. Von Unternehmen, in die der Teilfonds investierte, wurde erwartet, dass sie die Anforderungen des UNGC und der damit verbundenen Standards erfüllen. Unternehmen, die belegbar gegen einen der zehn Grundsätze des UNGC verstießen, wurden systematisch ausgeschlossen. Der Teilfonds führte verstärkte Due-Diligence-Prüfungen bei Unternehmen durch, die als nicht konform mit den Prinzipien des UNGC angesehen wurden oder die nach den unternehmenseigenen ESG Ratings von HSBC als risikoreich angesehen wurden. Darüber hinaus wurden die Unternehmen nach internationalen Standards wie den OECD-Leitsätzen bewertet.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen. Hierbei gelten spezifische von der Union definierte Kriterien.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*



## Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die von diesem Teilfonds berücksichtigten PAI waren:

- Treibhausgasintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1 und Scope 2)
- Verstöße gegen die Prinzipien des UNGC und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD)
- Anteil der Investitionen mit Beteiligung an umstrittenen Waffen

Der Ansatz zur Berücksichtigung der PAI beinhaltete unter anderem, dass HSBC das Engagement der Unternehmen für den Übergang zu CO<sub>2</sub>-armen Wirtschaften, die zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern sowie die Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette prüfte, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails.

Das Screening führte dazu, dass HSBC nicht in bestimmte Unternehmen und Emittenten investierte.



## Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der Investitionen** entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden: basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des Bezugszeitraums zum 31.03.2024

| Größte Investitionen                        | Sektor                         | % der Vermögenswerte | Land                           |
|---|--------------------------------|----------------------|--------------------------------|
| Microsoft Corporation                       | Informationstechnologie        | 5,10 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Apple Inc.                                  | Informationstechnologie        | 3,86 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| NVIDIA Corporation                          | Informationstechnologie        | 1,83 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| UnitedHealth Group Incorporated             | Gesundheitswesen               | 1,65 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Amazon.com, Inc.                            | Zyklische Konsumgüter          | 1,49 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Home Depot, Inc.                            | Zyklische Konsumgüter          | 1,43 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Alphabet Inc. Klasse A                      | Kommunikationsdienstleistungen | 1,37 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Adobe Inc.                                  | Informationstechnologie        | 1,20 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Cisco Systems, Inc.                         | Informationstechnologie        | 1,17 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Texas Instruments Incorporated              | Informationstechnologie        | 1,14 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| International Business Machines Corporation | Informationstechnologie        | 1,11 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Applied Materials, Inc.                     | Informationstechnologie        | 1,10 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Coca-Cola Company                           | Basiskonsumgüter               | 1,10 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Lam Research Corporation                    | Informationstechnologie        | 1,09 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| American Express Company                    | Finanzen                       | 1,08 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |

Barmittel und Derivate wurden nicht berücksichtigt

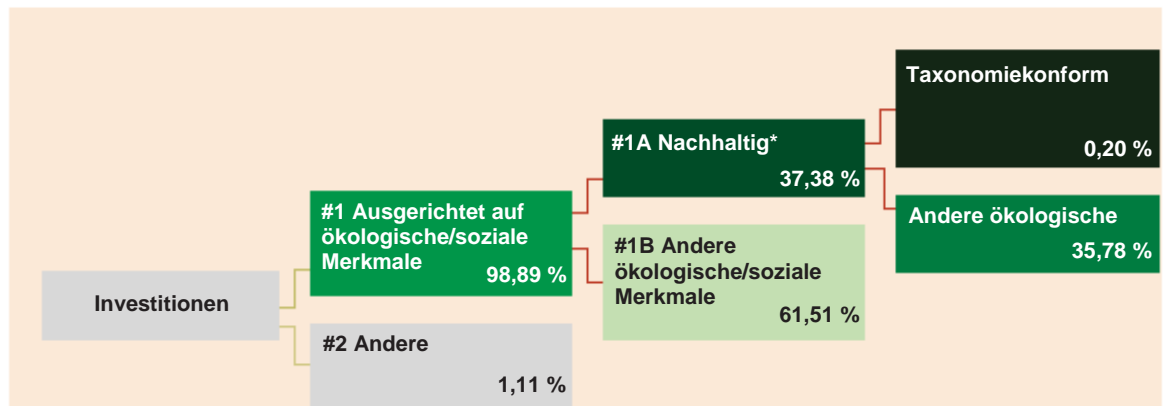


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

37,38 % des Portfolios waren in nachhaltige Vermögenswerte investiert.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

### ● *Wie sah die Vermögensallokation aus?*



**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**#2 Andere Investitionen** umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

\* Ein Unternehmen oder Emittent, das bzw. der als nachhaltige Investition angesehen wird, kann sowohl zu einem sozialen als auch zu einem ökologischen Ziel beitragen, das an der EU-Taxonomie ausgerichtet sein kann oder nicht. Die Zahlen in der obigen Grafik berücksichtigen dies. Jedoch darf eine Gesellschaft oder ein Emittent unter dem Punkt der nachhaltigen Investitionen (#1A Nachhaltige Investitionen) nur einmal erfasst werden.

Die Prozentzahlen von taxonomiekonformen Investitionen und Andere ökologische Merkmale stimmen aufgrund der unterschiedlichen Berechnungsmethoden für nachhaltige Investitionen und taxonomiekonforme Investitionen nicht mit #1A Nachhaltige Investitionen überein.

## In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

| Sektor / Teilsektor                              | % der Vermögenswerte |
|--|----------------------|
| Informationstechnologie                          | 25,25 %              |
| Finanzen   | 17,21 %              |
| Industriegüter                                   | 13,90 %              |
| Gesundheitswesen                                 | 11,30 %              |
| Zyklische Konsumgüter                            | 10,30 %              |
| Energie  | 6,52 %               |
| <i>Integrierter Öl- und Gaskonzern</i>           | <i>1,14 %</i>        |
| <i>Exploration und Produktion von Öl und Gas</i> | <i>3,76 %</i>        |
| <i>Raffination und Vertrieb von Öl und Gas</i>   | <i>0,83 %</i>        |
| <i>Lagerung und Transport von Öl und Gas</i>     | <i>0,78 %</i>        |
| Kommunikationsdienstleistungen                   | 4,54 %               |
| Basiskonsumgüter                                 | 4,16 %               |
| Grundstoffe                                      | 3,04 %               |
| Immobilien                                       | 2,33 %               |
| Barmittel und Derivate                           | 1,08 %               |
| Versorger  | 0,34 %               |
| <i>Stromversorgungsbetriebe</i>                  | <i>0,09 %</i>        |
| <i>Erdgas</i>                                    | <i>0,07 %</i>        |
| <i>Multi-Versorger</i>                           | <i>0,18 %</i>        |
| Summe  | 100,00 %             |

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.



## Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

Der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen ist in den obigen Feldern zur Vermögensallokation ersichtlich.

### Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

Ja:
  In fossiles Gas
  In Kernenergie

Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

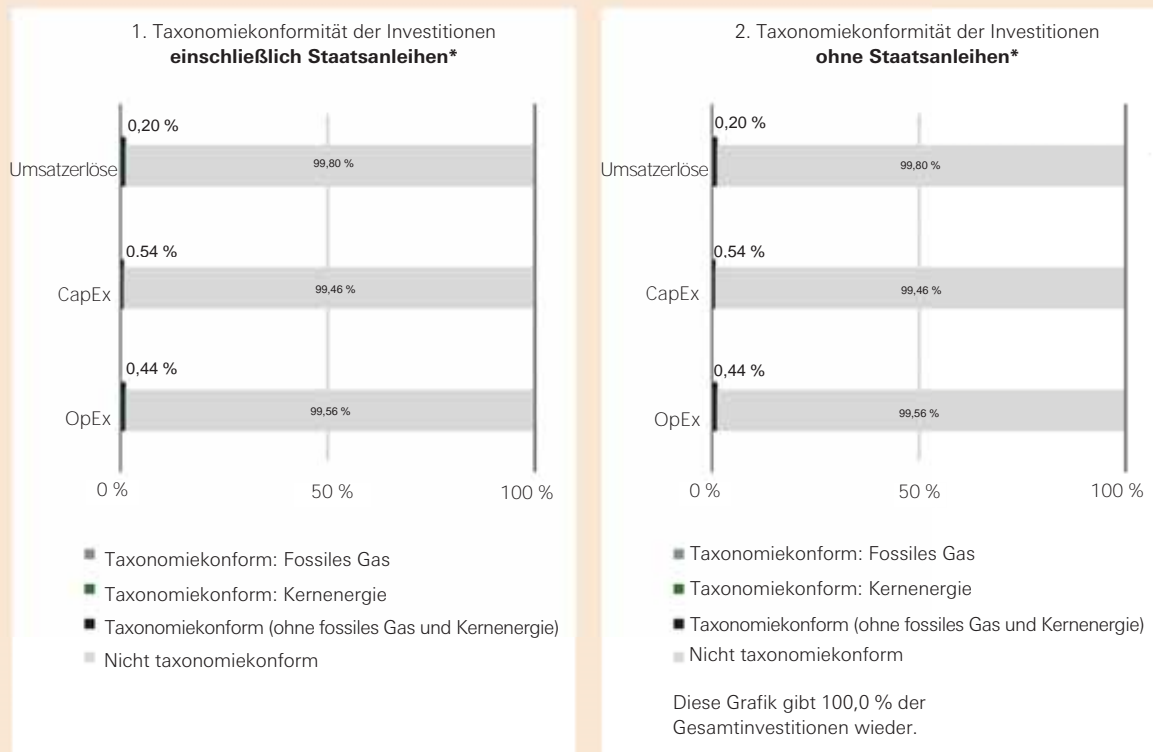
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen.

- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

**Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

**Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.**



\* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

**Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Im Referenzzeitraum betrug der Anteil der Investitionen des Fonds, die in Übergangstätigkeiten geflossen sind, 0,02 % und der Anteil der Investitionen, die in ermöglichende Tätigkeiten geflossen ist, 0,16 %.

**Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

| Indikator   | 2023-2024 | 2022-2023 |
|---|-----------|-----------|
| Umsatz – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                       | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform: Kernenergie                        | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie) | 0,20 %    | 0,00 %    |
| Umsatz – Nicht taxonomiekonform                               | 99,80 %   | 100,00 %  |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                        | n. z.     | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                         | n. z.     | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)  | 0,54 %    | 0,00 %    |
| CAPEX – Nicht taxonomiekonform                                | 99,46 %   | 100,00 %  |
| OPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                         | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                          | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)   | 0,44 %    | 0,00 %    |
| OPEX – Nicht taxonomiekonform                                 | 99,56 %   | 100,00 %  |

Da es sich erst um den zweiten Berichtszeitraum des Teilfonds handelt, ist ein Vergleich mit der Zeit davor nicht erforderlich.



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?**

Der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel war 35,78 %. Aufgrund der mangelnden Abdeckung und der fehlenden Daten hat sich der Teilfonds nicht verpflichtet, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen.



### **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Teilfonds investierte nicht in sozial nachhaltige Anlagen.



### **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

#2 Andere Investitionen umfasst die Finanzinstrumente, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden. In manchen Fällen ist dies auf die Nichtverfügbarkeit von Daten und Unternehmensmaßnahmen zurückzuführen. Diese Positionen unterlagen nach wie vor dem vollständigen Ausschluss-Screening von HSBC und wurden im Hinblick auf verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Prinzipien des UNGC und der OECD geprüft.

Der Teilfonds hielt Barmittel / Barmitteläquivalente (der Prozentsatz der gehaltenen Barmittel ist in der obigen Tabelle der Sektoren/Teilspektoren unter der Überschrift „In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?“ ersichtlich) zum Zwecke des Liquiditätsmanagements sowie derivative Finanzinstrumente zum Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements. Barmittel / Barmitteläquivalente und derivative Finanzinstrumente verfügen aufgrund der Art dieser Instrumente über keinen ökologischen oder sozialen Mindestschutz.



### **Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?**

Im Laufe des Berichtszeitraums schloss der Anlageberater unter anderem verbotene Waffen, umstrittene Waffen, Unternehmen, die mehr als 10 % ihres Umsatzes aus Kraftwerkskohle und Energieerzeugung aus Kohle generieren, und Tabakherstellung aus und investierte in Unternehmen mit verantwortungsvollen Geschäftspraktiken gemäß den Prinzipien des UNGC.

Um die Kohlenstoffintensität des Portfolios zu senken und seinen ESG-Score zu erhöhen, wurden alle Positionen im Portfolio bei jeder monatlichen Neugewichtung auf ihre individuelle Kohlenstoffintensität und ESG-Scores hin überprüft.

Mithilfe eines von HSBC entwickelten systematischen Anlageverfahrens wurde ein Portfolio erstellt, das das Engagement in den gewünschten Faktoren maximiert, um die finanziellen Ziele zu erreichen, aber auch eine geringere Kohlenstoffintensität und einen höheren ESG-Score als der MSCI World, der den Referenzwert darstellt, anstrebt. Infolgedessen hatte der Teilfonds während des gesamten Berichtszeitraums einen höheren ESG-Score und eine geringere Kohlenstoffintensität als der Referenzwert.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Nicht zutreffend.

- **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?**

Nicht zutreffend.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.



Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen 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.

**Name des Produkts:** HSBC GLOBAL INVESTMENT FUNDS - GLOBAL SUSTAINABLE LONG TERM DIVIDEND

**Unternehmenskennung (LEI-Code):** 213800Q412OUFUB41202

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

| <input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> <input type="checkbox"/> <b>Ja</b>   | <input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> <b>Nein</b>  |
|--|---|
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel</b> getätigt: _ %<br><br><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><br><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit <b>ökologische/soziale Merkmale beworben</b> und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 87,35 % an nachhaltigen Investitionen<br><br><input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><br><input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><br><input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel |
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel</b> getätigt: _ %  | <input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine <b>nachhaltigen Investitionen getätigt</b>   |



### Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Während des Geschäftsjahres zum 31. März 2024 (der Bezugszeitraum) bewarb der Teilfonds die folgenden Merkmale:

1. Der Teilfonds prüfte und analysierte alle Unternehmen oder Emittenten im Hinblick auf ökologische Merkmale, insbesondere physische Risiken durch den Klimawandel und Personalmanagement.
2. Für die zugrunde liegenden E-, S- und G-Säulen wurden ein Screening sowie ein Vergleich mit dem für den Teilfonds definierten Referenzwert durchgeführt. „E“ und „S“ spiegeln die einzelnen Elemente der vom Teilfonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale wider, „G“ die Unternehmensführungspraktiken, die die Interessen von Minderheitsaktionären schützen und eine langfristige nachhaltige Wertschöpfung fördern.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

3. Der Teilfonds berücksichtigte verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Grundsätzen des Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC) und den Leitsätzen für multinationale Unternehmen der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für Unternehmen. Der Teilfonds schloss Geschäftstätigkeiten aus, die als umweltschädlich gelten, wie z. B. die Förderung von Kraftwerkskohle und die Kohleverstromung.

4. Der Teilfonds berücksichtigte aktiv ökologische und soziale Aspekte, indem er über unsere Engagement- und Stewardship-Teams Mitwirkung bei Emittenten umsetzte und sein Recht zur Stimmrechtsvertretung wahrnahm.

5. Der Teilfonds schloss nach entsprechender Analyse Anlagen in umstrittenen Waffen aus.

Der ESG-Score stammt vom externen ESG-Datenanbieter MSCI. Die Berücksichtigung einzelner (in der nachstehenden Tabelle nummerierter) wichtigster nachteiliger Indikatoren (PAI) drückt sich darin aus, dass der Teilfonds niedrigere Werte als der Referenzwert aufweist. Die bei der Berechnung der PAI-Werte verwendeten Daten stammen von externen Datenanbietern. Sie können auf Unternehmensangaben basieren oder von den Datenanbietern geschätzt werden wo keine solchen Angaben vorliegen. Bitte beachten Sie, dass es nicht immer möglich ist, die Richtigkeit, Aktualität oder Vollständigkeit der von Drittanbietern bereitgestellten Daten zu garantieren.

Der Teilfonds wurde aktiv verwaltet und bildete keinen Referenzwert nach. Der Referenzwert diente zum Vergleich des Teilfonds mit dem allgemeinen Markt, nicht jedoch der Erreichung der vom Teilfonds beworbenen ökologischen Merkmale.

Die Entwicklung der Nachhaltigkeitskennzahlen ist in der nachfolgenden Tabelle dargestellt.

Das Abschneiden der Nachhaltigkeitsindikatoren, die der Teilfonds zur Messung der Erreichung der von ihm beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet, ist in der folgenden Tabelle dargestellt. Es wurde auf das Erreichen eines ESG-Score des Teilfonds hingearbeitet, der über dem vom Teilfonds ausgewählten Referenzindex liegt (ein höherer Score als der Referenzwert bedeutet bessere ESG-Referenzen).

Alle Unternehmen haben eine gute Unternehmensführung bewiesen, was sich am PAI-Score 10 unten ablesen lässt.

### **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

| <b>Indikator</b>   | <b>Teilfonds</b> | <b>Referenzwert</b> |
|--|------------------|---------------------|
| ESG-Score  | 8,42             | 7,15                |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO2-Äquivalente pro Million Euro Umsatz  | 74,16            | 186,00              |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 0,00 %           | 0,77 %              |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 0,00 %           | 1,10 %              |

Die Daten in diesem regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung beziehen sich auf den Stand vom 31. März 2024, basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des am 31. März 2024 endenden Geschäftsjahres.

Referenzwert - MSCI World High Dividend Yield

### ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

| Indikator  | Zeitraum zum  | Teilfonds | Referenzwert |
|--|---------------|-----------|--------------|
| ESG-Score  | 31. März 2024 | 8,42      | 7,15         |
|  | 31. März 2023 | 8,43      | 7,04         |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente pro Million Euro Umsatz   | 31. März 2024 | 74,16     | 186,00       |
|  | 31. März 2023 | 74,96     | 219,29       |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 31. März 2024 | 0,00 %    | 0,77 %       |
|  | 31. März 2023 | 0,00 %    | 1,52 %       |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 31. März 2024 | 0,00 %    | 1,10 %       |
|  | 31. März 2023 | 0,00 %    | 0,00 %       |

Da es sich erst um den zweiten regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung handelt, ist kein Vergleich mit vorangegangenen Zeiträumen möglich.

### **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die vom Teilfonds getätigten nachhaltigen Investitionen trugen unter anderem zu folgenden ökologischen und sozialen Zielen bei.

1. Reduzierung von Treibhausgasemissionen und Verringerung des CO<sub>2</sub>-Fußabdrucks;
2. Übergang zu oder die Nutzung von erneuerbarer Energie.

Der Teilfonds strebte Erträge aus Dividenden und ein langfristiges Kapitalwachstum an, indem er in Unternehmen investierte, die langfristig vom Übergang zu einer nachhaltigeren Weltwirtschaft profitieren können („nachhaltige Unternehmen“), wobei er ESG-Merkmale im Sinne von Artikel 8 der Offenlegungsverordnung bewarb.

Nach Ausschluss der Unternehmen, die an den ausgeschlossenen Aktivitäten beteiligt waren, wurden auf der Grundlage von eigenem Research bestimmte Nachhaltigkeitskriterien anhand einer 3-Punkte-Skala oder einer ähnlichen Einstufungsskala bewertet und eingestuft. Die Nachhaltigkeitskriterien unterlagen kontinuierlichem Research und konnten sich im Laufe der Zeit ändern. Sie konnten jedoch auch die Nachhaltigkeit von Praktiken und Kultur, die Nachhaltigkeit des Geschäftsmodells und die Nachhaltigkeit der Produkte umfassen. Anschließend zog der Anlageberater die Nachhaltigkeitskriterien-Einstufung eines Unternehmens und dessen Übereinstimmung mit den Zielen für nachhaltige Entwicklung der Vereinten Nationen heran, um eine erste Entscheidung darüber zu treffen, ob ein Unternehmen als ein nachhaltiges Unternehmen anzusehen ist.

### **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Wir bestätigen, dass wir nachhaltige Vermögenswerte darauf geprüft haben, ob sie erhebliche Beeinträchtigungen verursachen können. Dies erfolgte im Rahmen des Standard-Anlageprozesses von HSBC Asset Management (HSBC) und unter Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen.

*Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?*

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 Anlageberater hat alle durch die Offenlegungsverordnung definierten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI) auf ihre Relevanz für den Teilfonds geprüft. Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren legt fest, wie HSBC die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen identifiziert und darauf reagiert, und in welcher Form HSBC Nachhaltigkeitsrisiken berücksichtigt, die sich negativ auf Wertpapiere auswirken können, in die der Teilfonds investiert. HSBC identifizierte in Zusammenarbeit mit externen Screening-Dienstleistern wie Sustainalytics, ISS, MSCI und Trucost Unternehmen und Staaten mit schlechter Bilanz beim Management von ESG-Risiken, und wo solche wesentlichen Risiken identifiziert wurden, führte HSBC zusätzliche Due Diligence-Prüfungen durch. Durch Screening identifizierte Nachhaltigkeitsauswirkungen, einschließlich der relevanten PAI, bildeten einen Schlüsselfaktor beim Anlageentscheidungsprozess.

Der oben beschriebene Ansatz führte dazu, dass unter anderem folgende Faktoren geprüft wurden:

- Engagement der Unternehmen für den Übergang zu CO2-armen Wirtschaften, zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern, Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus großen Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails; und
- Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit folgenden Bereichen: demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.

Die spezifischen PAI für diesen Teilfonds waren wie unten beschrieben.

Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren ist auf der Website [www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies](http://www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies) verfügbar.

*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:*

HSBC hat sich der Anwendung und Förderung globaler Standards verpflichtet. Die wichtigsten Schwerpunktbereiche der Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren entsprachen den zehn UNGC-Grundsätzen. Diese Grundsätze stehen in Zusammenhang mit nicht finanziellen Risiken in den Bereichen Menschenrechte, Arbeit, Umweltschutz und Korruptionsbekämpfung. HSBC gehört darüber hinaus zu den Unterzeichnern der UN Principles for Responsible Investment. Diese bildeten den Rahmen für Ermittlung und Management von Nachhaltigkeitsrisiken beim Investmentansatz von HSBC. Von Unternehmen, in die der Teilfonds investierte, wurde erwartet, dass sie die Anforderungen des UNGC und der damit verbundenen Standards erfüllen. Unternehmen, die belegbar gegen einen der zehn Grundsätze des UNGC verstießen, wurden systematisch ausgeschlossen. Der Teilfonds führte verstärkte Due-Diligence-Prüfungen bei Unternehmen durch, die als nicht konform mit den Prinzipien des UNGC angesehen wurden oder die nach den unternehmenseigenen ESG Ratings von HSBC als risikoreich angesehen wurden. Darüber hinaus wurden die Unternehmen nach internationalen Standards wie den OECD-Leitsätzen bewertet.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen. Hierbei gelten spezifische von der Union definierte Kriterien.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*



## Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die von diesem Teilfonds berücksichtigten PAI waren:

- Treibhausgasintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1 und Scope 2)
- Verstöße gegen die UNGC- und OECD-Grundsätze
- Anteil der Investitionen mit Beteiligung an umstrittenen Waffen

Der Ansatz zur Berücksichtigung der PAI beinhaltete unter anderem, dass HSBC das Engagement der Unternehmen für den Übergang zu CO2-armen Wirtschaften, die zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern sowie die Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette prüfte, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails.

Das Screening führte dazu, dass HSBC nicht in bestimmte Unternehmen und Emittenten investierte.



## Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der Investitionen** entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden: basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des Bezugszeitraums zum 31.03.2024

| Größte Investitionen                              | Sektor                         | % der Vermögenswerte | Land                           |
|---|--------------------------------|----------------------|--------------------------------|
| ASML Holding NV                                   | Informationstechnologie        | 8,11 %               | Niederlande                    |
| Microsoft Corporation                             | Informationstechnologie        | 6,16 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Intuit Inc.                                       | Informationstechnologie        | 5,98 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Coloplast A/S Class B                             | Gesundheitswesen               | 5,80 %               | Dänemark                       |
| Automatic Data Processing, Inc.                   | Industriegüter                 | 5,62 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Visa Inc. Class A                                 | Finanzen                       | 4,85 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Kone Oyj Class B                                  | Industriegüter                 | 4,73 %               | Finnland                       |
| Recordati Industria Chimica e Farmaceutica S.p.A. | Gesundheitswesen               | 4,72 %               | Italien                        |
| Nintendo Co., Ltd.                                | Kommunikationsdienstleistungen | 4,40 %               | Japan                          |

Barmittel und Derivate wurden nicht berücksichtigt

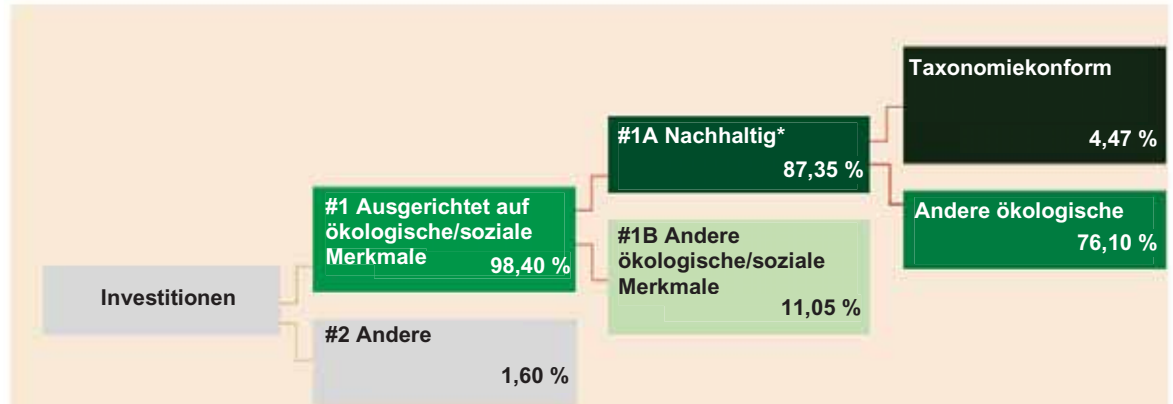


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

87,35 % des Portfolios waren in nachhaltige Vermögenswerte investiert.

Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?



**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**#2 Andere Investitionen** umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

\* Ein Unternehmen oder Emittent, das bzw. der als nachhaltige Investition angesehen wird, kann sowohl zu einem sozialen als auch zu einem ökologischen Ziel beitragen, das an der EU-Taxonomie ausgerichtet sein kann oder nicht. Die Zahlen in der obigen Grafik berücksichtigen dies. Jedoch darf eine Gesellschaft oder ein Emittent unter dem Punkt der nachhaltigen Investitionen (#1A Nachhaltige Investitionen) nur einmal erfasst werden.

Die Prozentzahlen von taxonomiekonformen Investitionen und Andere ökologische Merkmale stimmen aufgrund der unterschiedlichen Berechnungsmethoden für nachhaltige Investitionen und taxonomiekonforme Investitionen nicht mit #1A Nachhaltige Investitionen überein.

### In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

| Sektor / Teilsektor             | % der Vermögenswerte |
|---------------------------------|----------------------|
| Informationstechnologie         | 19,09 %              |
| Gesundheitswesen                | 18,98 %              |
| Basiskonsumgüter                | 16,84 %              |
| Industriegüter                  | 15,35 %              |
| Grundstoffe                     | 7,80 %               |
| Zyklische Konsumgüter           | 6,64 %               |
| Finanzen                        | 4,86 %               |
| Versorger                       | 4,55 %               |
| <i>Stromversorgungsbetriebe</i> | 4,55 %               |
| Kommunikationsdienstleistungen  | 4,29 %               |
| Barmittel und Derivate          | 1,60 %               |
| Summe                           | 100,00 %             |



Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

## Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

Der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen ist in den obigen Feldern zur Vermögensallokation ersichtlich.

### Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

Ja:
  In fossiles Gas
  In Kernenergie

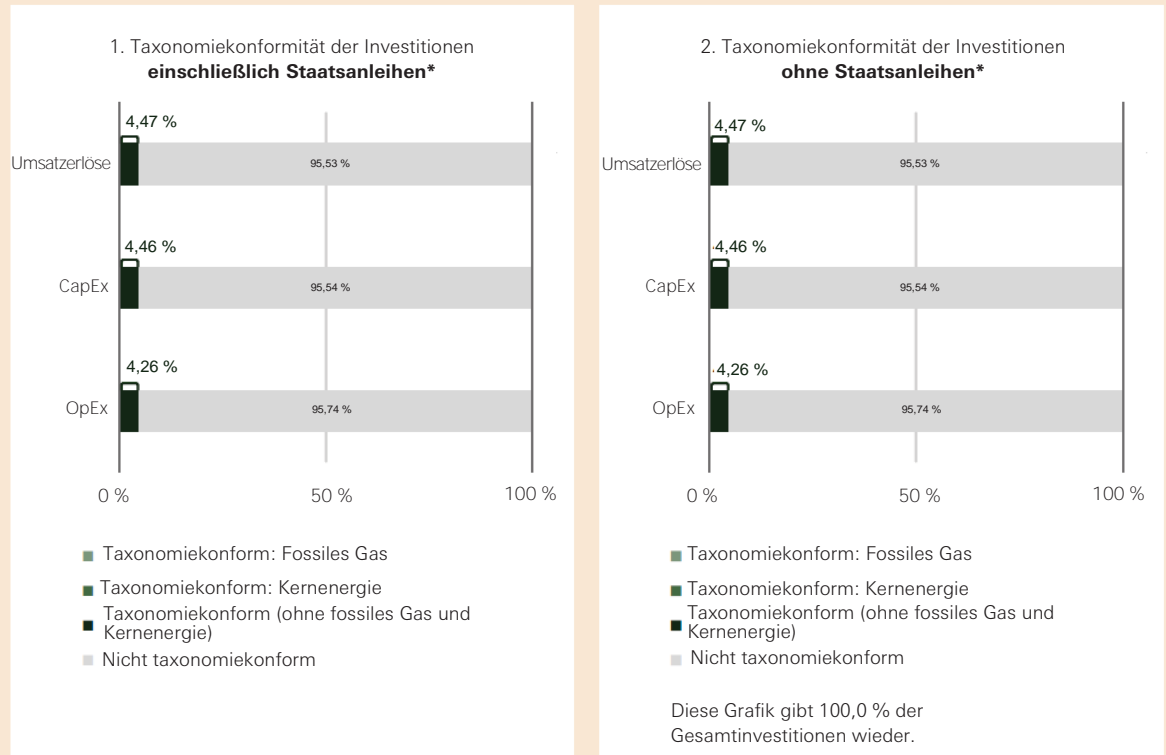
Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

**Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.**



\* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

**Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

### Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?


Im Referenzzeitraum betrug der Anteil der Investitionen des Fonds, die in Übergangstätigkeiten geflossen sind, 0,00 % und der Anteil der Investitionen, die in ermöglichende Tätigkeiten geflossen ist, 4,46 %.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

| Indikator   | 2023-2024 | 2022-2023 |
|---|-----------|-----------|
| Umsatz – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                       | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform: Kernenergie                        | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie) | 4,47 %    | 0,00 %    |
| Umsatz – Nicht taxonomiekonform                               | 95,53 %   | 100,00 %  |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                        | n. z.     | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                         | n. z.     | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)  | 4,46 %    | 0,00 %    |
| CAPEX – Nicht taxonomiekonform                                | 95,54 %   | 100,00 %  |
| OPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                         | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                          | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)   | 4,26 %    | 0,00 %    |
| OPEX – Nicht taxonomiekonform                                 | 95,74 %   | 100,00 %  |

Da es sich erst um den zweiten Berichtszeitraum des Teilfonds handelt, ist ein Vergleich mit der Zeit davor nicht erforderlich.

 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?**

Der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel war 76,10 %. Der Teilfonds hat sich nicht verpflichtet, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen.

 **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Teilfonds investierte nicht in sozial nachhaltige Anlagen.

 **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

#2 Andere Investitionen umfasst die Finanzinstrumente, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden. In manchen Fällen ist dies auf die Nichtverfügbarkeit von Daten und Unternehmensmaßnahmen zurückzuführen. Diese Positionen unterlagen nach wie vor dem vollständigen Ausschluss-Screening von HSBC und wurden im Hinblick auf verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Prinzipien des UNGC und der OECD geprüft.

Der Teilfonds hielt Barmittel / Barmitteläquivalente (der Prozentsatz der gehaltenen Barmittel ist in der obigen Tabelle der Sektoren/Teilsektoren unter der Überschrift „In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?“ ersichtlich) zum Zwecke des Liquiditätsmanagements sowie derivative Finanzinstrumente zum Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements. Barmittel / Barmitteläquivalente und derivative Finanzinstrumente verfügen aufgrund der Art dieser Instrumente über keinen ökologischen oder sozialen Mindestschutz.



**Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?**

Im Laufe des Berichtszeitraums schloss der Anlageberater unter anderem verbotene Waffen, umstrittene Waffen, Unternehmen, die mehr als 10 % ihres Umsatzes aus Kraftwerkskohle und Energieerzeugung aus Kohle generieren, und Tabakherstellung aus und investierte in Unternehmen mit verantwortungsvollen Geschäftspraktiken gemäß den Prinzipien des UNGC.



Alle Positionen des Portfolios wurden hinsichtlich ihrer individuellen Treibhausgasintensität bewertet. Der Teilfonds bewertete auch ESG-Scores mit dem Ergebnis, dass der ESG-Score während des gesamten Berichtszeitraums vergleichbar mit dem des Referenzwertes war.

Darüber hinaus wurden alle Positionen auf Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der OECD untersucht, um Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung innerhalb des Portfolios sicherzustellen.



### **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

● ***Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?***

Nicht zutreffend.

● ***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?***

Nicht zutreffend.

● ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?***

Nicht zutreffend.

● ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?***

Nicht zutreffend.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Name des Produkts: HSBC GLOBAL INVESTMENT FUNDS - HONG KONG EQUITY

Unternehmenskennung (LEI-Code): 213800ZW305YHRYHI687

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen 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?

| <input checked="" type="checkbox"/> <input checked="" type="checkbox"/> <input type="checkbox"/> <b>Ja</b>  | <input checked="" type="checkbox"/> <input type="checkbox"/> <input checked="" type="checkbox"/> <b>Nein</b>  |
|---|---|
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel</b> getätigt: _ %<br><br><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><br><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><br><input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel</b> getätigt: _ % | <input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit <b>ökologische/soziale Merkmale beworben</b> und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 14,22 % an nachhaltigen Investitionen<br><br><input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><br><input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind<br><br><input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel<br><br><input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine <b>nachhaltigen Investitionen getätigt</b> |



### Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Während des Geschäftsjahres zum 31. März 2024 (der Bezugszeitraum) bewarb der Teilfonds Folgendes:

- Aktive Berücksichtigung von Investitionen mit geringer CO2-Intensität im Vergleich zum Referenzwert.
- Der Teilfonds prüfte und analysierte alle Unternehmen oder Emittenten im Hinblick auf ökologische Merkmale, insbesondere physische Risiken durch den Klimawandel und Personalmanagement. Für die zugrunde liegenden E-, S- und G-Säulen wurde ein Screening durchgeführt. „E“ und „S“ spiegeln die einzelnen Elemente der vom Teilfonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale wider, „G“ die Unternehmensführungspraktiken, die die Interessen von Minderheitsaktionären schützen und eine langfristige nachhaltige Wertschöpfung fördern.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

3. Der Teilfonds berücksichtigte verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Grundsätzen des Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC) und den Leitsätzen für multinationale Unternehmen der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für Unternehmen. Wurden potenzielle Verstöße gegen die Prinzipien des UNGC festgestellt, wurden die Emittenten einer eigenen Due-Diligence-Prüfung hinsichtlich ESG-Themen unterzogen, um festzustellen, ob sie für die Aufnahme in das Portfolio des Teilfonds geeignet sind, und sie auszuschließen, falls sie als ungeeignet erachtet wurden.
4. Der Teilfonds schloss Geschäftstätigkeiten aus, die als umweltschädlich gelten, wie z. B. die Förderung von Kraftwerkskohle und die Kohleverstromung.
5. Der Teilfonds berücksichtigte aktiv ökologische und soziale Aspekte, indem er über unsere Engagement- und Stewardship-Teams Mitwirkung bei Emittenten umsetzte und sein Recht zur Stimmrechtsvertretung wahrnahm.
6. Der Teilfonds schloss nach entsprechender Analyse Anlagen in umstrittenen Waffen aus.

Die auf Nachhaltigkeitsindikatoren bezogenen Scores werden anhand der proprietären Methodik von HSBC Asset Management und externer ESG-Datenanbieter berechnet. Die Berücksichtigung einzelner (in der nachstehenden Tabelle nummerierter) wichtigster nachteiliger Indikatoren (PAI) drückt sich darin aus, dass der Teilfonds niedrigere Werte als der Referenzwert aufweist. Die bei der Berechnung der PAI-Werte verwendeten Daten stammen von externen Datenanbietern. Sie können auf Unternehmensangaben basieren oder von den Datenanbietern geschätzt werden, wo keine solchen Angaben vorliegen. Bitte beachten Sie, dass es nicht immer möglich ist, die Richtigkeit, Aktualität oder Vollständigkeit der von Drittanbietern bereitgestellten Daten zu garantieren.

Der Teilfonds wurde aktiv verwaltet und bildete keinen Referenzwert nach. Ein internes oder externes Ziel des Teilfonds bestand im Übertreffen des Referenzwerts, der jedoch nicht zum Erreichen der vom Teilfonds beworbenen ökologischen Merkmale diente.

Das Abschneiden der Nachhaltigkeitsindikatoren, die der Teilfonds zur Messung der Erreichung der von ihm beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet, ist in der folgenden Tabelle dargestellt.

Alle Unternehmen haben eine gute Unternehmensführung bewiesen, was sich am PAI-Score 10 unten ablesen lässt.

### **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

| <b>Indikator</b>   | <b>Teilfonds</b> | <b>Referenzwert</b> |
|--|------------------|---------------------|
| 1. THG-Emissionen – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente  | 4.041,59         | 260.060.990,07      |
| 2. CO <sub>2</sub> -Fußabdruck – Tonnen CO <sub>2</sub> pro Million Euro (EVIC)  | 34,13            | 144,84              |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente pro Million Euro Umsatz   | 77,82            | 251,52              |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 11,34 %          | 12,48 %             |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 0,00 %           | 0,00 %              |

Die Daten in diesem regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung beziehen sich auf den Stand vom 31. März 2024, basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des am 31. März 2024 endenden Geschäftsjahres.

Referenzwert – FTSE MPF Hong Kong

## ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

| Indikator  | Zeitraum zum  | Teilfonds | Referenzwert   |
|--|---------------|-----------|----------------|
| 1. THG-Emissionen – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente  | 31. März 2024 | 4.041,59  | 260.060.990,07 |
|  | 31. März 2023 | 6.752,00  | 298.728.712,66 |
| 2. CO <sub>2</sub> -Fußabdruck – Tonnen CO <sub>2</sub> pro Million Euro (EVIC)  | 31. März 2024 | 34,13     | 144,84         |
|  | 31. März 2023 | 53,11     | 136,43         |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente pro Million Euro Umsatz   | 31. März 2024 | 77,82     | 251,52         |
|  | 31. März 2023 | 139,78    | 262,14         |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 31. März 2024 | 11,34 %   | 12,48 %        |
|  | 31. März 2023 | 13,32 %   | 13,14 %        |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 31. März 2024 | 0,00 %    | 0,00 %         |
|  | 31. März 2023 | 0,00 %    | 0,06 %         |

Da es sich erst um den zweiten regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung handelt, ist kein Vergleich mit vorangegangenen Zeiträumen möglich.

## **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die vom Teilfonds getätigten nachhaltigen Investitionen trugen unter anderem zu folgenden ökologischen Zielen bei:

1. Reduzierung von Treibhausgasemissionen und Verringerung des CO<sub>2</sub>-Fußabdrucks;
2. Übergang zu oder die Nutzung von erneuerbarer Energie.

Der Teilfonds bezog die Identifizierung und Analyse der ESG-Referenzen eines Unternehmens als integralen Bestandteil in den Anlageentscheidungsprozess ein, um die Bewertung von Risiken und potenziellen Renditen zu unterstützen.

## **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Wir bestätigen, dass wir nachhaltige Vermögenswerte darauf geprüft haben, ob sie erhebliche Beeinträchtigungen verursachen können. Dies erfolgte im Rahmen des Standard-Anlageprozesses von HSBC Asset Management (HSBC) und unter Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen.

*Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?*

Der Anlageberater hat alle durch die Offenlegungsverordnung definierten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI) auf ihre Relevanz für den Teilfonds geprüft. Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren legt fest, wie HSBC die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen identifiziert und darauf reagiert, und in welcher Form HSBC Nachhaltigkeitsrisiken berücksichtigt, die sich negativ auf Wertpapiere auswirken können, in die der Teilfonds investiert. HSBC identifizierte in Zusammenarbeit mit externen Screening-Dienstleistern wie Sustainalytics, ISS, MSCI und Trucost Unternehmen und Staaten mit schlechter Bilanz beim Management von ESG-Risiken, und wo solche wesentlichen Risiken identifiziert wurden, führte HSBC zusätzliche Due Diligence-Prüfungen durch. Durch Screening identifizierte Nachhaltigkeitsauswirkungen, einschließlich der relevanten PAI, bildeten einen Schlüsselfaktor beim Anlageentscheidungsprozess.

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 oben beschriebene Ansatz führte dazu, dass unter anderem folgende Faktoren geprüft wurden:

- Engagement der Unternehmen für den Übergang zu CO<sub>2</sub>-armen Wirtschaften, zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern, Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus großen Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails; und
- Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit folgenden Bereichen: demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.

Die spezifischen PAI für diesen Teilfonds waren wie unten beschrieben.

Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren ist auf der Website [www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies](http://www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies) verfügbar.

*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:*

HSBC hat sich der Anwendung und Förderung globaler Standards verpflichtet. Die wichtigsten Schwerpunktbereiche der Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren entsprachen den zehn UNGC-Grundsätzen. Diese Grundsätze stehen in Zusammenhang mit nicht finanziellen Risiken in den Bereichen Menschenrechte, Arbeit, Umweltschutz und Korruptionsbekämpfung. HSBC gehört darüber hinaus zu den Unterzeichnern der UN Principles for Responsible Investment. Diese bildeten den Rahmen für Ermittlung und Management von Nachhaltigkeitsrisiken beim Investmentansatz von HSBC. Von Unternehmen, in die der Teilfonds investierte, wurde erwartet, dass sie die Anforderungen des UNGC und der damit verbundenen Standards erfüllen. Unternehmen, die belegbar gegen einen der zehn Grundsätze des UNGC verstießen, wurden systematisch ausgeschlossen. Der Teilfonds führte verstärkte Due-Diligence-Prüfungen bei Unternehmen durch, die als nicht konform mit den Prinzipien des UNGC angesehen wurden oder die nach den unternehmenseigenen ESG Ratings von HSBC als risikoreich angesehen wurden. Darüber hinaus wurden die Unternehmen nach internationalen Standards wie den OECD-Leitsätzen bewertet.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen. Hierbei gelten spezifische von der Union definierte Kriterien.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*



## Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Teilfonds berücksichtigte die folgenden PAI, indem er sie als Nachhaltigkeitsindikatoren beobachtete:

- Treibhausgasemissionen (Scope 1 und Scope 2)
- CO<sub>2</sub>-Fußabdruck (Scope 1 und Scope 2)
- Treibhausgasintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1 und Scope 2)
- Verstöße gegen die UNGC- und OECD-Grundsätze; und
- Anteil der Investitionen mit Beteiligung an umstrittenen Waffen

Der Ansatz zur Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen beinhaltete unter anderem, dass HSBC das Engagement der Unternehmen für den Übergang zu kohlenstoffarmem Wirtschaften, die zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern sowie die Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette prüfte, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails. Ebenfalls berücksichtigt wurde das Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit den Bereichen demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung. Ausgeschlossen waren auch Unternehmen, deren Geschäftsaktivitäten als umweltschädlich eingestuft wurden.

Das Screening führte dazu, dass HSBC nicht in bestimmte Unternehmen und Emittenten investierte.



## Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der Investitionen** entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden: basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des Bezugszeitraums zum 31.03.2024

| Größte Investitionen                         | Sektor                         | % der Vermögenswerte | Land  |
|--|--------------------------------|----------------------|---|
| HSBC Holdings Plc                            | Finanzen                       | 9,55 %               | Vereinigtes Königreich von Großbritannien und Nordirland. |
| Tencent Holdings Ltd.                        | Kommunikationsdienstleistungen | 9,54 %               | China   |
| Alibaba Group Holding Limited                | Zyklische Konsumgüter          | 8,33 %               | China   |
| China Construction Bank Corporation Class H  | Finanzen                       | 6,39 %               | China   |
| AIA Group Limited                            | Finanzen                       | 4,57 %               | Hongkong  |
| Netease Inc                                  | Kommunikationsdienstleistungen | 4,46 %               | China   |
| China Mobile Limited                         | Kommunikationsdienstleistungen | 4,24 %               | China   |
| Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd. | Informationstechnologie        | 4,13 %               | Taiwan  |

Barmittel und Derivate wurden nicht berücksichtigt

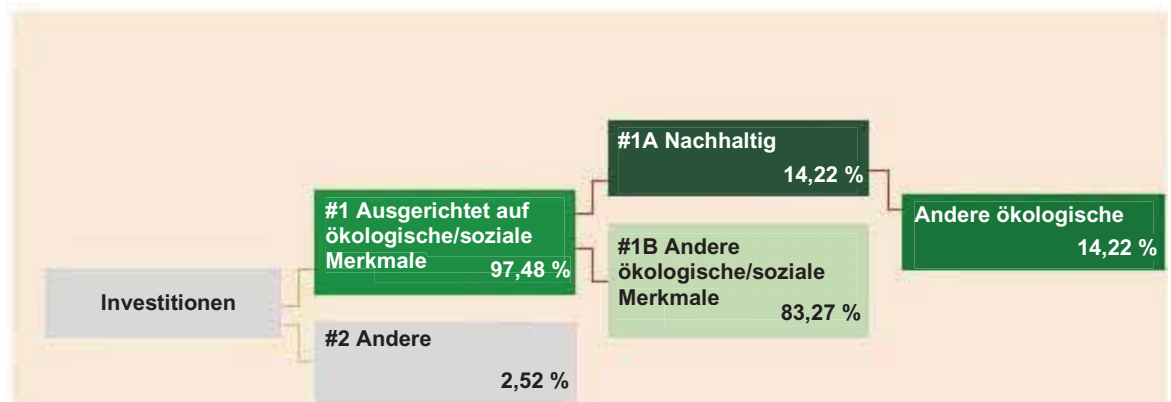


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

14,22 % des Portfolios waren in nachhaltige Vermögenswerte investiert.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?



**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**#2 Andere Investitionen** umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

### In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

| Sektor / Teilsektor                       | % der Vermögenswerte |
|---|----------------------|
| Finanzen                                  | 28,43 %              |
| Kommunikationsdienstleistungen            | 21,72 %              |
| Zyklische Konsumgüter                     | 18,03 %              |
| Immobilien                                | 6,35 %               |
| Informationstechnologie                   | 6,27 %               |
| Versorger                                 | 4,44 %               |
| Stromversorgungsbetriebe                  | 3,42 %               |
| Erdgas                                    | 1,02 %               |
| Energie                                   | 3,33 %               |
| Exploration und Produktion von Öl und Gas | 3,33 %               |
| Industriegüter                            | 2,72 %               |
| Gesundheitswesen                          | 2,21 %               |
| Barmittel und Derivate                    | 2,08 %               |
| Staatsanleihen                            | 1,67 %               |
| Basiskonsumgüter                          | 1,51 %               |
| Grundstoffe                               | 1,21 %               |
| Andere                                    | 0,04 %               |
| Summe                                     | 100,00 %             |



Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

## Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

Der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen lag bei 0 %. Der Teilfonds hat sich nicht verpflichtet, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen.

### Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

Ja:
  In fossiles Gas
  In Kernenergie

Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

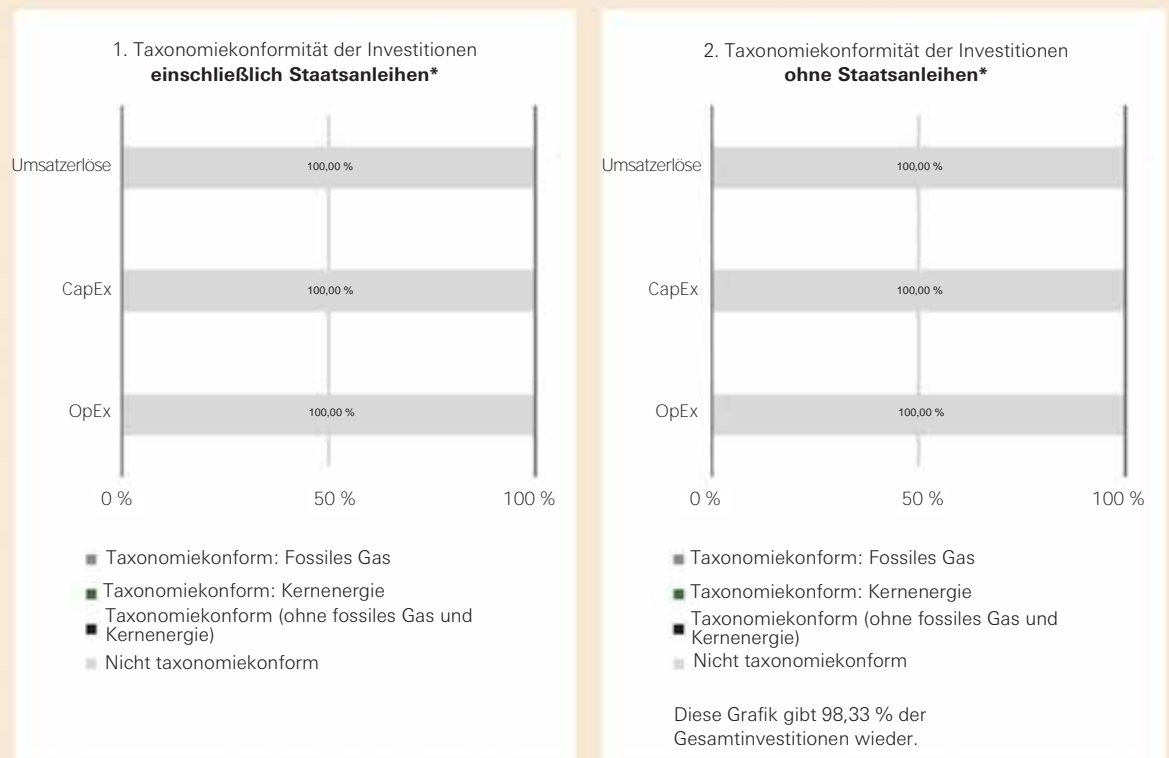
Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

### Übergangstätigkeiten

sind Wirtschaftstätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

*Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.*



\* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

### Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Im Referenzzeitraum betrug der Anteil der Investitionen des Fonds, die in Übergangstätigkeiten geflossen sind, 0,00 % und der Anteil der Investitionen, die in ermöglichende Tätigkeiten geflossen ist, 0,00 %.




**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

| Indikator   | 2023-2024 | 2022-2023 |
|---|-----------|-----------|
| Umsatz – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                       | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform: Kernenergie                        | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie) | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Nicht taxonomiekonform                               | 100,00 %  | 100,00 %  |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                        | n. z.     | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                         | n. z.     | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)  | n. z.     | 0,00 %    |
| CAPEX – Nicht taxonomiekonform                                | 100,00 %  | 100,00 %  |
| OPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                         | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                          | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)   | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Nicht taxonomiekonform                                 | 100,00 %  | 100,00 %  |

Da es sich erst um den zweiten Berichtszeitraum des Teilfonds handelt, ist ein Vergleich mit der Zeit davor nicht erforderlich.

 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?**

Der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel war 14,22 %. Der Teilfonds hat sich nicht verpflichtet, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen.


 **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Teilfonds investierte nicht in sozial nachhaltige Anlagen.

 **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

#2 Andere Investitionen umfasst die Finanzinstrumente, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden. In manchen Fällen ist dies auf die Nichtverfügbarkeit von Daten und Unternehmensmaßnahmen zurückzuführen. Diese Positionen unterlagen nach wie vor dem vollständigen Ausschluss-Screening von HSBC und wurden im Hinblick auf verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Prinzipien des UNGC und der OECD geprüft.

Der Teilfonds hielt Barmittel / Barmitteläquivalente (der Prozentsatz der gehaltenen Barmittel ist in der obigen Tabelle der Sektoren/Teilsektoren unter der Überschrift „In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?“ ersichtlich) zum Zwecke des Liquiditätsmanagements sowie derivative Finanzinstrumente zum Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements. Barmittel / Barmitteläquivalente und derivative Finanzinstrumente verfügen aufgrund der Art dieser Instrumente über keinen ökologischen oder sozialen Mindestschutz.

 **Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?**

Im Laufe des Berichtszeitraums schloss der Anlageberater unter anderem verbotene Waffen, umstrittene Waffen, Unternehmen, die mehr als 10 % ihres Umsatzes aus Kraftwerkskohle und Energieerzeugung aus Kohle generieren, und Tabakherstellung aus und investierte in Unternehmen mit verantwortungsvollen Geschäftspraktiken gemäß den Prinzipien des UNGC.

Alle Positionen im Portfolio wurden hinsichtlich ihrer individuellen Kohlenstoffintensität untersucht, was zu einer Kohlenstoffintensität des Portfolios führte, die besser als die des Referenzwerts war. Der Teilfonds bewertete auch ESG-Scores mit dem Ergebnis, dass der ESG-Score während des gesamten Berichtszeitraums über dem des Referenzwerts lag.

Wurden außerdem wesentliche ESG-Risiken oder ein potenzieller Verstoß gegen einen oder mehrere der zehn Prinzipien des UNGC festgestellt, führte der Portfoliomanager/Analyst eine intensive Due-Diligence-Prüfung in Bezug auf ESG-Themen durch. Zudem war die Genehmigung des Investitionsausschusses erforderlich, bevor Investitionen getätigt werden konnten.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend.

### ● **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Nicht zutreffend.

### ● **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?**

Nicht zutreffend.

### ● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

### ● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

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

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen 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.

**Name des Produkts:** HSBC GLOBAL INVESTMENT FUNDS - GLOBAL EMERGING MARKETS CORPORATE SUSTAINABLE BOND

**Unternehmenskennung (LEI-Code):** 2138001DWNLVT5HF8T24

## Nachhaltiges Investitionsziel

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

**Ja**

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: **98,56 %**

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: **\_ %**

**Nein**

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es **\_ %** an nachhaltigen Investitionen

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben**, aber keine **nachhaltigen Investitionen getätigt**



### Inwieweit wurde das nachhaltige Investitionsziel des Finanzprodukts erreicht?

Während des Geschäftsjahres zum 31. März 2024 (der Bezugszeitraum) bewarb der Teilfonds Folgendes:

- Der Teilfonds investierte in ein Portfolio aus festverzinslichen Wertpapieren von Unternehmen/Emittenten, die aktiv zum Erreichen der Ziele für nachhaltige Entwicklung der Vereinten Nationen (UN-SDGs) beitragen. Insbesondere zu den Zielen Maßnahmen zum Klimaschutz, bezahlbare und saubere Energie, sauberes Wasser und Sanitäreinrichtungen, Gesundheit und Wohlergehen sowie weniger Ungleichheiten.
- Prinzipien des United Nations Global Compact (UNGC) und OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen (OECD). Wurden potenzielle Verstöße gegen die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC) festgestellt, wurden die Emittenten einer eigenen Due-Diligence-Prüfung hinsichtlich ESG-Themen unterzogen, um festzustellen, ob sie für die Aufnahme in das Portfolio des Teilfonds geeignet sind, und sie auszuschließen, falls sie als ungeeignet erachtet wurden.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die nachhaltigen Ziele dieses Finanzprodukts erreicht werden.

3. Der Teilfonds schloss als umweltschädlich eingestufte Geschäftsaktivitäten aus, wie Kraftwerkskohle und Energieerzeugung aus Kohle.
4. Der Teilfonds prüfte und analysierte alle Unternehmen/Emittenten im Hinblick auf ökologische Merkmale, insbesondere physische Risiken durch den Klimawandel und Personalmanagement. Für die zugrunde liegenden E-, S- und G-Säulen wurden ein Screening sowie ein Vergleich mit dem für den Teilfonds definierten Referenzwert durchgeführt. „E“ und „S“ spiegeln die einzelnen Elemente des vom Teilfonds beworbenen nachhaltigen Anlageziels wider, „G“ die Unternehmensführungspraktiken, die die Interessen von Minderheitsaktionären schützen und langfristige nachhaltige Wertschöpfung fördern.
5. Der Teilfonds berücksichtigte aktiv ökologische und soziale Aspekte, indem er über unsere Engagement- und Stewardship-Teams Mitwirkung bei Emittenten umsetzte, wo HSBC Asset Management dies für angemessen hielt.
6. Der Teilfonds schloss nach entsprechender Analyse Anlagen in umstrittenen Waffen aus.

Die Berücksichtigung einzelner (in der nachstehenden Tabelle nummerierter) wichtigster nachteiliger Indikatoren (PAI) drückt sich darin aus, dass der Teilfonds niedrigere Werte als der Referenzwert aufweist. Die bei der Berechnung der PAI-Werte verwendeten Daten stammen von externen Datenanbietern. Sie können auf Unternehmens-/Emittentenangaben basieren oder von den Datenanbietern geschätzt werden wo keine solchen Angaben vorliegen. Bitte beachten Sie, dass es nicht immer möglich ist, die Richtigkeit, Aktualität oder Vollständigkeit der von Drittanbietern bereitgestellten Daten zu garantieren.

Der Referenzwert diente zum Vergleich des Teilfonds mit dem allgemeinen Markt, nicht jedoch der Erreichung des vom Teilfonds beworbenen nachhaltigen Investitionsziels.

Das Abschneiden der Nachhaltigkeitsindikatoren, die der Teilfonds zur Messung der Erreichung des von ihm beworbenen nachhaltigen Anlageziels verwendet, ist in der folgenden Tabelle dargestellt.

Alle Emittenten wiesen Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung vor, die sich durch den unten aufgeführten PAI 10-Score ausdrücken

### ● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

| Indikator  | Teilfonds | Referenzwert  |
|--|-----------|---------------|
| 1. THG-Emissionen – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente  | 13.837,33 | 73.735.494,55 |
| 2. CO <sub>2</sub> -Fußabdruck – Tonnen CO <sub>2</sub> pro Million Euro (EVIC)  | 132,82    | 159,28        |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente pro Million Euro Umsatz   | 194,11    | 522,00        |
| 4. Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind   | 0,00 %    | 0,00 %        |
| 6. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren - GWh pro Million Euro Umsatz  | 0,00      | 0,00          |
| 8. Emissionen in Wasser – in tausend metrische Tonnen pro Million Euro Investition   | 0,00      | 0,00          |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 0,00 %    | 3,39 %        |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 0,00 %    | 0,00 %        |

Die Daten in diesem regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung beziehen sich auf den Stand vom 31. März 2024, basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des am 31. März 2024 endenden Geschäftsjahres.

Referenzwert - JP Morgan CEMBI Broad Diversified

## ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

| Indikator  | Zeitraum zum  | Teilfonds | Referenzwert  |
|--|---------------|-----------|---------------|
| 1. THG-Emissionen – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente  | 31. März 2024 | 13.837,33 | 73.735.494,55 |
|  | 31. März 2023 | 0,00      | 0,00          |
| 2. CO <sub>2</sub> -Fußabdruck – Tonnen CO <sub>2</sub> pro Million Euro (EVIC)  | 31. März 2024 | 132,82    | 159,28        |
|  | 31. März 2023 | 0,00      | 0,00          |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente pro Million Euro Umsatz   | 31. März 2024 | 194,11    | 522,00        |
|  | 31. März 2023 | 0,00      | 0,00          |
| 4. Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind   | 31. März 2024 | 0,00 %    | 0,00 %        |
|  | 31. März 2023 | 0,00 %    | 20,41 %       |
| 6. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren - GWh pro Million Euro Umsatz  | 31. März 2024 | 0,00      | 0,00          |
|  | 31. März 2023 | 13,15     | 1.394,07      |
| 8. Emissionen in Wasser – in tausend metrische Tonnen pro Million Euro Investition   | 31. März 2024 | 0,00      | 0,00          |
|  | 31. März 2023 | 0,00      | 0,00          |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 31. März 2024 | 0,00 %    | 3,39 %        |
|  | 31. März 2023 | 0,00 %    | 5,33 %        |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 31. März 2024 | 0,00 %    | 0,00 %        |
|  | 31. März 2023 | 0,00 %    | 0,06 %        |

Da es sich erst um den zweiten regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung handelt, ist kein Vergleich mit vorangegangenen Zeiträumen möglich.

## Inwiefern wurden nachhaltige Investitionsziele durch die nachhaltigen Investitionen nicht erheblich beeinträchtigt?

Wir bestätigen, dass wir nachhaltige Vermögenswerte darauf geprüft haben, ob sie erhebliche Beeinträchtigungen verursachen können. Dies erfolgte im Rahmen des Standard-Anlageprozesses von HSBC Asset Management (HSBC) und unter Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen.

### *Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?*

Der Anlageberater hat alle durch die Offenlegungsverordnung definierten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI) auf ihre Relevanz für den Teilfonds geprüft. Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren legt fest, wie HSBC die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen identifiziert und darauf reagiert, und in welcher Form HSBC Nachhaltigkeitsrisiken berücksichtigt, die sich negativ auf Wertpapiere auswirken können, in die der Teilfonds investiert. HSBC identifizierte in Zusammenarbeit mit externen Screening-Dienstleistern, wie Sustainalytics, ISS, MSCI und Trucost, Unternehmen und Regierungen mit schlechter Bilanz beim Management von ESG-Risiken, und wo solche wesentlichen Risiken identifiziert wurden, führte HSBC zusätzliche ESG-Due-Diligence-Prüfungen durch. Durch Screening identifizierte Nachhaltigkeitsauswirkungen einschließlich der PAI bildeten einen Schlüsselfaktor beim Anlageentscheidungsprozess.

Der oben beschriebene Ansatz führte dazu, dass unter anderem folgende Faktoren geprüft wurden:

- Engagement der Unternehmen für den Übergang zu CO<sub>2</sub>-armen Wirtschaften, zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von

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.

Mitarbeitern, Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus großen Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails; und

- Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit folgenden Bereichen: demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.

Die spezifischen PAI für diesen Teilfonds waren wie unten beschrieben.

Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren ist auf der Website [www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies](http://www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies) verfügbar.

*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:*

HSBC hat sich der Anwendung und Förderung globaler Standards verpflichtet. Die wichtigsten Schwerpunktbereiche der Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren entsprachen den zehn UNGC-Grundsätzen. Diese Grundsätze stehen in Zusammenhang mit nicht finanziellen Risiken in den Bereichen Menschenrechte, Arbeit, Umweltschutz und Korruptionsbekämpfung. HSBC gehört darüber hinaus zu den Unterzeichnern der UN Principles for Responsible Investment. Diese bildeten den Rahmen für Ermittlung und Management von Nachhaltigkeitsrisiken beim Investmentansatz von HSBC.

Von Unternehmen, in die der Teilfonds investierte, wurde erwartet, dass sie die Anforderungen des UNGC und der damit verbundenen Standards erfüllen. Unternehmen, die belegbar gegen einen der zehn Grundsätze des UNGC verstießen, wurden systematisch ausgeschlossen. Der Teilfonds führte verstärkte Due-Diligence-Prüfungen bei Unternehmen durch, die als nicht konform mit den Prinzipien des UNGC angesehen wurden oder die nach den unternehmenseigenen ESG Ratings von HSBC als risikoreich angesehen wurden. Darüber hinaus wurden die Unternehmen nach internationalen Standards wie den OECD-Leitsätzen bewertet.



### **Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Die vom Teilfonds berücksichtigte wichtigste nachteilige Auswirkungen waren:

- Treibhausgasemissionen (Scope 1 und Scope 2)
- CO<sub>2</sub>-Fußabdruck (Scope 1 und Scope 2)
- Treibhausgasintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1 und Scope 2)
- Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
- Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE-Code D: Versorgung mit Strom, Gas und Dampf sowie Klimatisierung
- Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren – NACE-Code E: Wasserversorgung; Kanalisation, Abfallmanagement und Sanierung
- Emissionen in Wasser

- Verstöße gegen die UNGC- und OECD-Grundsätze
- Anteil der Investitionen mit Beteiligung an umstrittenen Waffen

Der Ansatz zur Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen beinhaltet unter anderem, dass HSBC das Engagement der Unternehmen für den Übergang zu kohlenstoffarmem Wirtschaften, die zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern sowie die Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette prüfte, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails. Ebenfalls berücksichtigt wurde das Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit den Bereichen demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.



## Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** Investitionen entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden: basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des Bezugszeitraums zum 31.03.2024

| Größte Investitionen   | Sektor                         | % der Vermögen | Land                         |
|--|--------------------------------|----------------|------------------------------|
| Ct Trust 5,125 % 03.02.2032  | Kommunikationsdienstleistungen | 3,36 %         | Guatemala                    |
| Star Energy Geothermal (Wayang Windu) Ltd. 6,75 % 24.04.2033                             | Versorger                      | 3,34 %         | Indonesien                   |
| Maf Global Securities Ltd. 7,875 % Perp  | Immobilien                     | 3,05 %         | Vereinigte Arabische Emirate |
| Renew Wind Energy (AP 2) Pvt Ltd. 4,5 % 14.07.2028                                       | Versorger                      | 2,87 %         | Indien                       |
| Banco Mercantil Del Norte, S.A., Institucion De Banca Multiple, Grupo Finan 6,625 % Perp | Finanzen                       | 2,80 %         | Mexiko                       |
| Ambipar Lux S.a R.l. 9,875 % 06.02.2031  | Industriegüter                 | 2,68 %         | Brasilien                    |
| C&W Senior Financing DAC 6,875 % 15.09.2027  | Kommunikationsdienstleistungen | 2,64 %         | Puerto Rico                  |
| Greenko Power II Ltd. 4,3 % 13.12.2028   | Versorger                      | 2,46 %         | Indien                       |
| Ihs Holding Limited 5,625 % 29.11.2026   | Kommunikationsdienstleistungen | 2,37 %         | Nigeria                      |
| Inversiones Cmpc S.a. 3,0 % 06.04.2031   | Grundstoffe                    | 2,31 %         | Chile                        |
| HTA Group Ltd. (Mauritius) 7,0 % 18.12.2025  | Industriegüter                 | 2,14 %         | Tansania                     |
| Network I2i (Singapore) Pte Ltd. 3,975 % Perp  | Kommunikationsdienstleistungen | 2,10 %         | Indien                       |
| Rumo Luxembourg S.a R.l. 5,25 % 10.01.2028   | Industriegüter                 | 2,09 %         | Brasilien                    |
| Nonghyup Bank Co., Ltd. 4,875 % 03.07.2028   | Finanzen                       | 2,06 %         | Korea                        |
| Energo- Pro A.s. 11,0 % 02.11.2028   | Energie                        | 2,02 %         | Tschechische Republik        |

Barmittel und Derivate wurden nicht berücksichtigt

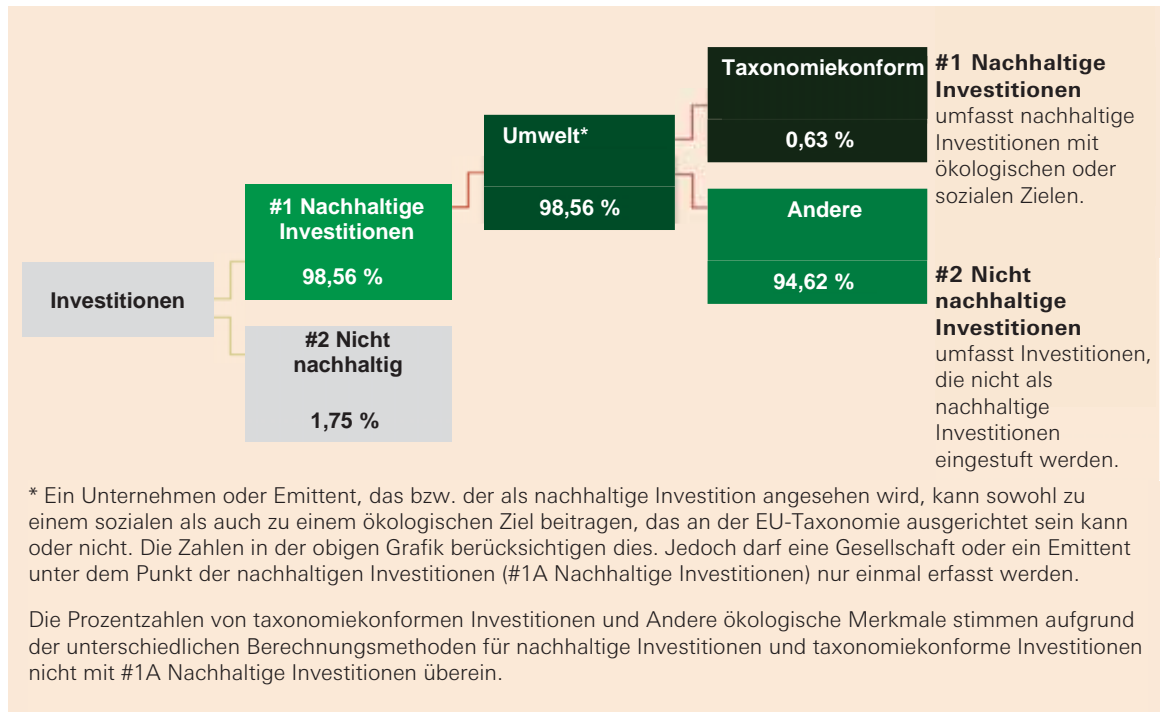


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

98,56 % des Portfolios waren in nachhaltige Vermögenswerte investiert.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?



### In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

| Sektor / Teilsektor                                 | % der Vermögenswerte |
|---|----------------------|
| Versorger   | 20,51 %              |
| <i>Stromversorgungsbetriebe</i>                     | 0,58 %               |
| <i>Erdgas</i>                                       | 1,57 %               |
| <i>Unabhängige Stromerzeuger und Energiehändler</i> | 6,64 %               |
| <i>Multi-Versorger</i>                              | 0,95 %               |
| Andere  | 18,47 %              |
| Kommunikationsdienstleistungen                      | 14,69 %              |
| Grundstoffe   | 12,49 %              |
| Finanzen  | 11,50 %              |
| Industriegüter                                      | 6,69 %               |
| Immobilien  | 5,93 %               |
| Zyklische Konsumgüter                               | 4,56 %               |
| Gesundheitswesen                                    | 2,08 %               |
| Basiskonsumgüter                                    | 1,33 %               |
| Barmittel und Derivate                              | 1,75 %               |
| Summe   | 100,00 %             |





## Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

Der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen ist in den obigen Feldern zur Vermögensallokation ersichtlich.

### Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

Ja:

In fossiles Gas

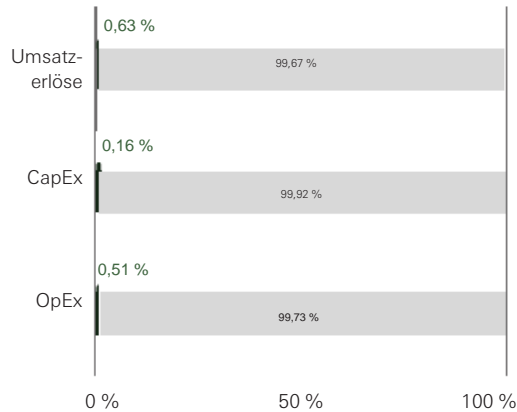
In Kernenergie

Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

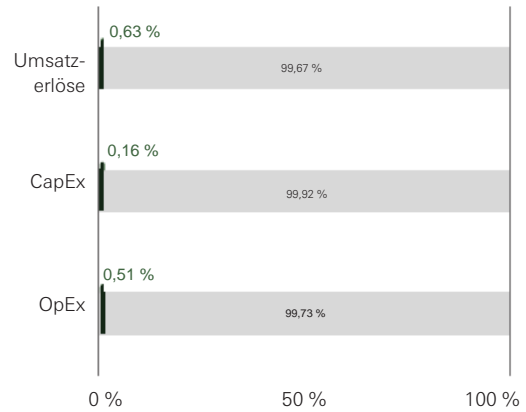
**Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.**

1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschließlich Staatsanleihen\*



- Taxonomiekonform: Fossiles Gas
- Taxonomiekonform: Kernenergie
- Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)
- Nicht taxonomiekonform

2. Taxonomiekonformität der Investitionen ohne Staatsanleihen\*



- Taxonomiekonform: Fossiles Gas
- Taxonomiekonform: Kernenergie
- Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)
- Nicht taxonomiekonform

Diese Grafik gibt 32,61 % der Gesamtinvestitionen wieder.

\* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

### Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Im Referenzzeitraum betrug der Anteil der Investitionen des Fonds, die in Übergangstätigkeiten geflossen sind, 0,00 % und der Anteil der Investitionen, die in ermöglichende Tätigkeiten geflossen ist, 0,04 %.

Mit Blick auf die EU-Taxonomekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Taxonomekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen.

- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.


**Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

| Indikator   | 2023-2024 | 2022-2023 |
|---|-----------|-----------|
| Umsatz – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                       | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform: Kernenergie                        | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie) | 0,63 %    | 0,00 %    |
| Umsatz – Nicht taxonomiekonform                               | 99,69 %   | 100,00 %  |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                        | 0,00 %    | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                         | n. z.     | 0,00 %    |
| CAPEX – Nicht taxonomiekonform                                | 99,92 %   | 100,00 %  |
| CAPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)  | 0,16 %    | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                         | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                          | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)   | 0,51 %    | 0,00 %    |
| OPEX – Nicht taxonomiekonform                                 | 99,74 %   | 100,00 %  |

Da es sich erst um den zweiten Berichtszeitraum des Teilfonds handelt, ist ein Vergleich mit der Zeit davor nicht erforderlich.

 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 nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden?**

Der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel war 94,62 %. Der Teilfonds hat sich nicht verpflichtet, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen.

 **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Teilfonds investierte nicht in sozial nachhaltige Anlagen.

 **Welche Investitionen fallen unter „nicht nachhaltige Investitionen“, welcher Anlagezweck wird mit ihnen verfolgt und gibt es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

#2 Andere Investitionen umfasst die Finanzinstrumente, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden. In manchen Fällen ist dies auf die Nichtverfügbarkeit von Daten und Unternehmensmaßnahmen zurückzuführen. Diese Positionen unterlagen nach wie vor dem vollständigen Ausschluss-Screening von HSBC und wurden im Hinblick auf verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Prinzipien des UNGC und der OECD geprüft.

Der Teilfonds hielt Barmittel / Barmitteläquivalente (der Prozentsatz der gehaltenen Barmittel ist in der obigen Tabelle der Sektoren/Teilektoren unter der Überschrift „In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?“ ersichtlich) zum Zwecke des Liquiditätsmanagements sowie derivative Finanzinstrumente zum Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements. Barmittel / Barmitteläquivalente und derivative Finanzinstrumente verfügen aufgrund der Art dieser Instrumente über keinen ökologischen oder sozialen Mindestschutz.



**Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung des nachhaltigen Investitionsziels ergriffen?**

Der Teilfonds erzielte durch integrierte Nachhaltigkeitsanalysen und kontinuierliches Engagement bei Emittenten in Schwellenmärkten positive Umweltauswirkungen. Diese kreditintensive Strategie konzentrierte sich auf rigoroses Kredit-Research und

Engagement, wobei die robuste HSBC-Anlageplattform für Schwellenmarktanleihen und die erstklassigen Analystenteams für Kredite und verantwortungsbewusste Investitionen (RI) genutzt wurden. Der Teilfonds ist ein SFDR-Teilfonds nach Artikel 9 mit einem spezifischen Nachhaltigkeitsziel: Sein Ziel besteht darin, in den Schwellenmärkten, die zu den größten Verursachern von Kohlendioxidemissionen der Welt gehören, positive Veränderungen und messbare Auswirkungen zu erzielen.

Die Nachhaltigkeitsbeurteilung stand im Mittelpunkt des Anlageverfahrens der Strategie. Im Rahmen des Bottom-up-Anlageverfahrens wurden die Unternehmensemittenten auf der Grundlage einer strengen Fundamentalanalyse und einer zukunftsgerichteten, integrierten Nachhaltigkeitsbeurteilung ausgewählt, die auf Folgendes abzielte:

1. Bewertung der aktuellen Nachhaltigkeitspläne und Herausforderungen eines Emittenten
2. Nachverfolgung der laufenden Fortschritte des Emittenten hinsichtlich Nachhaltigkeit auf der Grundlage von ESG-Daten und -Engagement
3. Messung der Erfolge des Emittenten in Bezug auf positive Veränderungen und Auswirkungen

Die Nachhaltigkeitsbeurteilung wurde von Mitgliedern des Kredit-Research- und RI-Teams durchgeführt, wobei die Namen der Emittenten dem ESG-Ausschuss für festverzinsliche Wertpapiere zur Genehmigung vorgelegt wurden. Jedem Emittenten wurde ein eigener Kreditanalyst zugewiesen, der die ausreichende Transparenz des Emittenten, dessen ESG-Daten und dessen Bereitschaft zum Engagement untersuchte. Auf der Grundlage unseres Engagements bei Emittenten, unserer Nachhaltigkeitsanalyse und unseres Screenings haben wir uns auf Emittenten konzentriert, die klare Nachhaltigkeitsziele verfolgen und bei deren Umsetzung Fortschritte zu verzeichnen sind. Bei diesem Auswahlverfahren wurden etwa 90 % des gesamten Unternehmensuniversums der Schwellenmärkte ausgeschlossen. (≈810 Emittenten).



### **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Nachhaltigkeitsreferenzwert abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

- ***Wie unterschied sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?***

Nicht zutreffend.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf das nachhaltige Investitionsziel bestimmt wird?***

Nicht zutreffend.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?***

Nicht zutreffend.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?***

Nicht zutreffend.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das nachhaltige Ziel des Finanzprodukts erreicht wird.

**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**

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen 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.

**Name des Produkts:** HSBC GLOBAL INVESTMENT FUNDS - GLOBAL EQUITY CIRCULAR ECONOMY

**Unternehmenskennung (LEI-Code):** 213800KB6BO3Z43JHW60

## Nachhaltiges Investitionsziel

| <b>Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?</b>  |   |
|---|---|
| <input checked="" type="checkbox"/> <input checked="" type="checkbox"/> <b>Ja</b>   | <input checked="" type="checkbox"/> <input type="checkbox"/> <b>Nein</b>  |
| <input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel</b> getätigt: <b>98,01 %</b> <ul style="list-style-type: none"> <li><input checked="" type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input checked="" type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> </ul> | <input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>ökologische/soziale Merkmale beworben</b> und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es _ % an nachhaltigen Investitionen <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel</li> </ul> |
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel</b> getätigt: _ %   | <input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt</b>   |



### **Inwieweit wurde das nachhaltige Investitionsziel des Finanzprodukts erreicht?**

Während des Geschäftsjahres zum 31. März 2024 (der Bezugszeitraum) hat der Teilfonds in Bezug auf das nachhaltige Anlageziel Folgendes erreicht:

- Der Teilfonds investierte in ein konzentriertes Portfolio aus Unternehmen, die einen aktiven Beitrag zum Übergang zu einer stärkeren Kreislaufwirtschaft auf weltweiter Ebene leisten, basierend auf den Grundsätzen, schon beim Produktdesign Abfall und Umweltverschmutzung zu vermeiden, eine langfristige Nutzung von Produkten und Materialien zu ermöglichen und die natürlichen Systeme zu regenerieren. Der Teilfonds hat eine positive Auswirkung auf Umwelt, Soziales und Unternehmensführung („ESG“)

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die nachhaltigen Ziele dieses Finanzprodukts erreicht werden.

erzielt, indem er in ein konzentriertes Portfolio aus Unternehmen investiert hat, die einen aktiven Beitrag zum Übergang zu einer stärkeren Kreislaufwirtschaft auf weltweiter Ebene geleistet haben, basierend auf den Grundsätzen, schon beim Produktdesign Abfall und Umweltverschmutzung zu vermeiden, eine langfristige Nutzung von Produkten und Materialien zu ermöglichen und die natürlichen Systeme zu regenerieren, und gleichzeitig eine langfristige Gesamtrendite angestrebt wurde.

2. Der Teilfonds berücksichtigte verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Grundsätzen des Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC) und den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen (OECD). Wurden potenzielle Verstöße gegen die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC) festgestellt, wurden die Emittenten einer eigenen Due-Diligence-Prüfung hinsichtlich ESG-Themen unterzogen, um festzustellen, ob sie für die Aufnahme in das Portfolio des Fonds geeignet sind, und sie auszuschließen, falls sie als ungeeignet erachtet wurden.
3. Der Teilfonds schloss Geschäftstätigkeiten aus, die als umweltschädlich gelten, wie z. B. die Förderung von Kraftwerkskohle und die Kohleverstromung.
4. Für die zugrunde liegenden E-, S- und G-Säulen wurden ein Screening sowie ein Vergleich mit dem für den Teilfonds definierten Referenzwert durchgeführt. „E“ und „S“ spiegeln die einzelnen Elemente des vom Teilfonds beworbenen nachhaltigen Anlageziels wider, „G“ die Unternehmensführungspraktiken, die die Interessen von Minderheitsaktionären schützen und langfristige nachhaltige Wertschöpfung fördern.
5. Der Teilfonds berücksichtigte aktiv ökologische und soziale Aspekte, indem er über unsere Engagement- und Stewardship-Teams Mitwirkung bei Emittenten umsetzte und sein Recht zur Stimmrechtsvertretung wahrnahm.
6. Der Teilfonds schloss nach entsprechender Analyse Anlagen in umstrittenen Waffen aus.

Die ESG-Scores stammen vom externen ESG-Datenanbieter MSCI. Die Berücksichtigung einzelner wichtigster nachteiliger Auswirkungen (PAI) wird in der nachstehenden Tabelle anhand ihrer Nummerierung im Vergleich zum Referenzwert angegeben. Die bei der Berechnung der PAI-Werte verwendeten Daten stammen von externen Datenanbietern. Sie können auf Unternehmensangaben basieren oder von den Datenanbietern geschätzt werden, wo keine solchen Angaben vorliegen. Bitte beachten Sie, dass es nicht immer möglich ist, die Richtigkeit, Aktualität oder Vollständigkeit der von Drittanbietern bereitgestellten Daten zu garantieren.

Der Referenzwert wurde nicht zum Zweck der Erreichung des nachhaltigen Investitionsziels des Teilfonds bestimmt.

Das Abschneiden der Nachhaltigkeitsindikatoren, die der Teilfonds zur Messung der Erreichung des von ihm beworbenen nachhaltigen Anlageziels verwendet, ist in der folgenden Tabelle dargestellt. Es wurde auf das Erreichen eines ESG-Score des Teilfonds hingearbeitet, der über dem vom Teilfonds ausgewählten Referenzindex liegt.

Alle Unternehmen haben eine gute Unternehmensführung bewiesen, was sich am PAI-Score 10 unten ablesen lässt.

### **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

| <b>Indikator</b>   | <b>Teilfonds</b> | <b>Referenzwert</b> |
|--|------------------|---------------------|
| ESG-Score  | 8,18             | 6,78                |
| E-Säule  | 6,46             | 6,66                |
| S-Säule  | 5,93             | 5,11                |
| G-Säule  | 6,54             | 5,65                |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente pro Million Euro Umsatz | 128,57           | 126,54              |

|  |        |        |
|--|--------|--------|
| 4. Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind   | 0,00 % | 7,20 % |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 0,00 % | 1,39 % |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 0,00 % | 0,22 % |

Die Daten in diesem regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung beziehen sich auf den Stand vom 31. März 2024, basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des am 31. März 2024 endenden Geschäftsjahres.

Referenzwert – MSCI All Country World

### ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

| Indikator  | Zeitraum zum  | Teilfonds | Referenzwert |
|--|---------------|-----------|--------------|
| ESG-Score  | 31. März 2024 | 8,18      | 6,78         |
|  | 31. März 2023 | 8,23      | 6,82         |
| E-Säule  | 31. März 2024 | 6,46      | 6,66         |
|  | 31. März 2023 | 6,70      | 6,60         |
| S-Säule  | 31. März 2024 | 5,93      | 5,11         |
|  | 31. März 2023 | 5,85      | 5,16         |
| G-Säule  | 31. März 2024 | 6,54      | 5,65         |
|  | 31. März 2023 | 6,62      | 5,66         |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente pro Million Euro Umsatz   | 31. März 2024 | 128,57    | 126,54       |
|  | 31. März 2023 | 150,78    | 154,34       |
| 4. Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind   | 31. März 2024 | 0,00 %    | 7,20 %       |
|  | 31. März 2023 | 0,00 %    | 7,62 %       |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 31. März 2024 | 0,00 %    | 1,39 %       |
|  | 31. März 2023 | 0,00 %    | 1,65 %       |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 31. März 2024 | 0,00 %    | 0,22 %       |
|  | 31. März 2023 | 0,00 %    | 0,00 %       |

Da es sich erst um den zweiten regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung handelt, ist kein Vergleich mit vorangegangenen Zeiträumen möglich.

### Inwiefern wurden nachhaltige Investitionsziele durch die nachhaltigen Investitionen nicht erheblich beeinträchtigt?

Wir bestätigen, dass wir nachhaltige Vermögenswerte darauf geprüft haben, ob sie erhebliche Beeinträchtigungen verursachen können. Dies erfolgte im Rahmen des Standard-Anlageprozesses von HSBC Asset Management (HSBC) und unter Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen.

#### Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageberater hat alle durch die Offenlegungsverordnung definierten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI) auf ihre Relevanz für den Teilfonds geprüft. Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren legt fest, wie HSBC die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen identifiziert und darauf reagiert, und in welcher Form HSBC Nachhaltigkeitsrisiken berücksichtigt, die sich negativ auf Wertpapiere auswirken können, in die der Teilfonds

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.

investiert. HSBC identifizierte in Zusammenarbeit mit externen Screening-Dienstleistern, wie Sustainalytics, ISS, MSCI und Trucost, Unternehmen und Regierungen mit schlechter Bilanz beim Management von ESG-Risiken, und wo solche wesentlichen Risiken identifiziert wurden, führte HSBC zusätzliche ESG-Due-Diligence-Prüfungen durch. Durch Screening identifizierte Nachhaltigkeitsauswirkungen einschließlich der PAI bildeten einen Schlüsselfaktor beim Anlageentscheidungsprozess.

Der oben beschriebene Ansatz führte dazu, dass unter anderem folgende Faktoren geprüft wurden:

- Engagement der Unternehmen für den Übergang zu CO<sub>2</sub>-armen Wirtschaften, zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern, Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus großen Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails; und
- Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit folgenden Bereichen: demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.

Die spezifischen PAI für diesen Teilfonds waren wie unten beschrieben.

Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren ist auf der Website [www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies](http://www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies) verfügbar.

*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:*

HSBC hat sich der Anwendung und Förderung globaler Standards verpflichtet. Die wichtigsten Schwerpunktbereiche der Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren entsprachen den zehn UNGC-Grundsätzen. Diese Grundsätze stehen in Zusammenhang mit nicht finanziellen Risiken in den Bereichen Menschenrechte, Arbeit, Umweltschutz und Korruptionsbekämpfung. HSBC gehört darüber hinaus zu den Unterzeichnern der UN Principles for Responsible Investment. Diese bildeten den Rahmen für Ermittlung und Management von Nachhaltigkeitsrisiken beim Investmentansatz von HSBC.

Von Unternehmen, in die der Teilfonds investierte, wurde erwartet, dass sie die Anforderungen des UNGC und der damit verbundenen Standards erfüllen. Unternehmen, die belegbar gegen einen der zehn Grundsätze des UNGC verstießen, wurden systematisch ausgeschlossen. Der Teilfonds führte verstärkte Due-Diligence-Prüfungen bei Unternehmen durch, die als nicht konform mit den Prinzipien des UNGC angesehen wurden oder die nach den unternehmenseigenen ESG Ratings von HSBC als risikoreich angesehen wurden. Darüber hinaus wurden die Unternehmen nach internationalen Standards wie den OECD-Leitsätzen bewertet.



## Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Teilfonds berücksichtigte die folgenden PAI, indem er sie als Nachhaltigkeitsindikatoren beobachtete:

- Treibhausgasintensität der Unternehmen, in die investiert wird (Scope 1 und Scope 2)
- Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
- Verstöße gegen die UNGC- und OECD-Grundsätze
- Anteil der Investitionen mit Beteiligung an umstrittenen Waffen

Der Ansatz zur Berücksichtigung der PAI beinhaltete unter anderem, dass HSBC das Engagement der Unternehmen für den Übergang zu CO<sub>2</sub>-armen Wirtschaften, die zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern sowie die Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette prüfte, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails. Ebenfalls berücksichtigt wurde das Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit den Bereichen demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.

Das Screening führte dazu, dass HSBC nicht in bestimmte Unternehmen und Emittenten investierte.





## Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** Investitionen entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden: basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des Bezugszeitraums zum 31.03.2024

| Größte Investitionen            | Sektor                  | % der Vermögenswerte | Land                           |
|---------------------------------|-------------------------|----------------------|--------------------------------|
| United Rentals, Inc.            | Industriegüter          | 3,77 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| ASML Holding NV                 | Informationstechnologie | 3,34 %               | Niederlande                    |
| Autodesk, Inc.                  | Informationstechnologie | 3,32 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Home Depot, Inc.                | Zyklische Konsumgüter   | 3,24 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| L'Oreal S.A.                    | Basiskonsumgüter        | 3,21 %               | Frankreich                     |
| Ecolab Inc.                     | Grundstoffe             | 3,18 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Intesa Sanpaolo S.p.A.          | Finanzen                | 3,07 %               | Italien                        |
| Waste Management, Inc.          | Industriegüter          | 2,97 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Cisco Systems, Inc.             | Informationstechnologie | 2,80 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Equinix, Inc.                   | Immobilien              | 2,80 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Stantec Inc                     | Industriegüter          | 2,73 %               | Kanada                         |
| Advanced Drainage Systems, Inc. | Industriegüter          | 2,71 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Veolia Environnement SA         | Versorger               | 2,68 %               | Frankreich                     |
| Cintas Corporation              | Industriegüter          | 2,66 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Sprouts Farmers Market, Inc.    | Basiskonsumgüter        | 2,64 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |

Barmittel und Derivate wurden nicht berücksichtigt

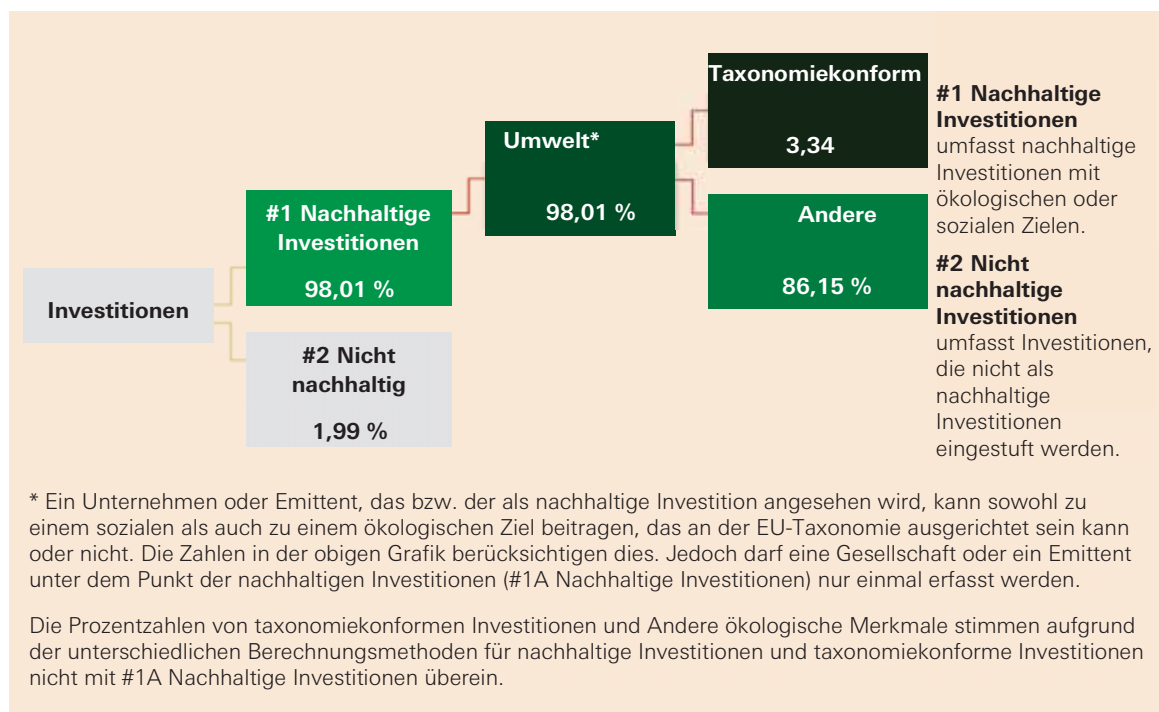


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

98,01 % des Portfolios waren in nachhaltige Vermögenswerte investiert.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?



● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

| Sektor / Teilsektor             | % der Vermögenswerte |
|---------------------------------|----------------------|
| Industriegüter                  | 26,91 %              |
| Informationstechnologie         | 19,49 %              |
| Basiskonsumgüter                | 11,16 %              |
| Grundstoffe                     | 11,12 %              |
| Zyklische Konsumgüter           | 9,58 %               |
| Versorger                       | 6,53 %               |
| <i>Stromversorgungsbetriebe</i> | 4,15 %               |
| <i>Multi-Versorger</i>          | 2,38 %               |
| Finanzen                        | 5,90 %               |
| Immobilien                      | 3,72 %               |
| Kommunikationsdienstleistungen  | 3,62 %               |
| Barmittel und Derivate          | 1,99 %               |
| Summe                           | 100,00 %             |

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen.



● **Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?**

Der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen ist in den obigen Feldern zur Vermögensallokation ersichtlich.

● **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?**

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

Nein

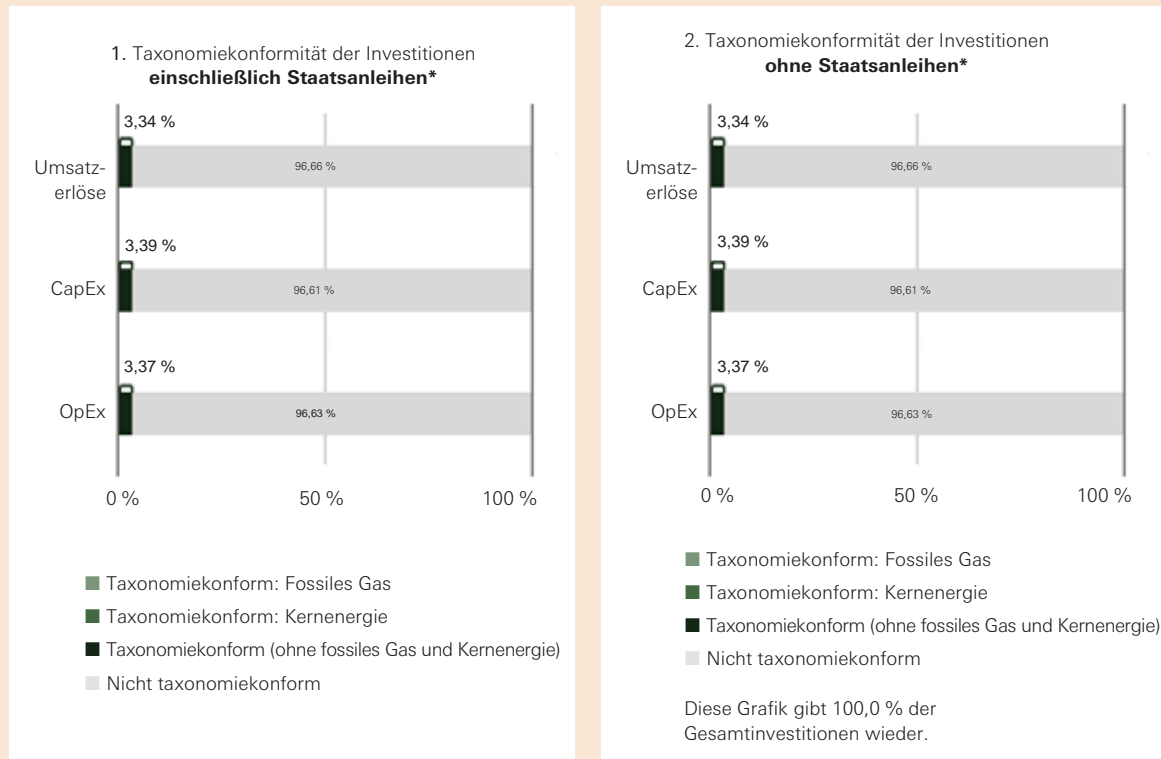
<sup>1</sup> Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

**Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

**Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.**



**Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Im Referenzzeitraum betrug der Anteil der Investitionen des Fonds, die in Übergangstätigkeiten geflossen sind, 0,49 % und der Anteil der Investitionen, die in ermöglichende Tätigkeiten geflossen ist, 1,66 %.

**Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

| Indikator   | 2023-2024 | 2022-2023 |
|---|-----------|-----------|
| Umsatz – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                       | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform: Kernenergie                        | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie) | 3,34 %    | 0,00 %    |
| Umsatz – Nicht taxonomiekonform                               | 96,66 %   | 100,00 %  |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                        | 0,00 %    | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                         | n. z.     | 0,00 %    |
| CAPEX – Nicht taxonomiekonform                                | 96,61 %   | 100,00 %  |
| CAPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)  | 3,39 %    | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                         | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                          | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)   | 3,37 %    | 0,00 %    |
| OPEX – Nicht taxonomiekonform                                 | 96,63 %   | 100,00 %  |

Da es sich erst um den zweiten Berichtszeitraum des Teilfonds handelt, ist ein Vergleich mit der Zeit davor nicht erforderlich.



## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden?

Der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel war 86,15 %. Der Teilfonds hat sich nicht verpflichtet, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen.



## Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Teilfonds investierte nicht in sozial nachhaltige Anlagen.



## Welche Investitionen fallen unter „nicht nachhaltige Investitionen“, welcher Anlagezweck wird mit ihnen verfolgt und gibt es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

#2 Andere Investitionen umfasst die Finanzinstrumente, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden. In manchen Fällen ist dies auf die Nichtverfügbarkeit von Daten und Unternehmensmaßnahmen zurückzuführen. Diese Positionen unterlagen nach wie vor dem vollständigen Ausschluss-Screening von HSBC und wurden im Hinblick auf verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Prinzipien des UNGC und der OECD geprüft.

Der Teilfonds hielt Barmittel / Barmitteläquivalente (der Prozentsatz der gehaltenen Barmittel ist in der obigen Tabelle der Sektoren/Teilsektoren unter der Überschrift „In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?“ ersichtlich) zum Zwecke des Liquiditätsmanagements sowie derivative Finanzinstrumente zum Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements. Barmittel / Barmitteläquivalente und derivative Finanzinstrumente verfügen aufgrund der Art dieser Instrumente über keinen ökologischen oder sozialen Mindestschutz.




## Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung des nachhaltigen Investitionsziels ergriffen?

Der Teilfonds hat eine positive Auswirkung auf Umwelt, Soziales und Unternehmensführung („ESG“) erzielt, indem er in ein konzentriertes Portfolio aus Unternehmen investiert hat, die einen aktiven Beitrag zum Übergang zu einer stärkeren Kreislaufwirtschaft auf weltweiter Ebene geleistet haben, basierend auf den Grundsätzen, schon beim Produktdesign Abfall und Umweltverschmutzung zu vermeiden, eine langfristige Nutzung von Produkten und Materialien zu ermöglichen und die natürlichen Systeme zu regenerieren.

Der Teilfonds hat mindestens 90 % seines Nettovermögens in Aktien und aktienähnlichen Wertpapieren von Unternehmen mit einem Engagement in Kreislaufwirtschaftsthemen („Kreislaufwirtschaftsthemen“) investiert, die in beliebigen Ländern, darunter sowohl entwickelte Märkte als auch Schwellenmärkte, domiziliert oder ansässig sind oder dort den größten Teil ihrer Geschäftstätigkeit ausüben oder dort an einem geregelten Markt notiert sind.

Zu jeder Zeit befinden sich 100 % der Vermögenswerte des Portfolios auf der Whitelist – im Einklang mit unserem Rahmenwerk für nachhaltige Investitionen, das die Anwendung ausgeschlossener Aktivitäten in Übereinstimmung mit den Richtlinien von HSBC Global Asset Management für verantwortungsbewusstes Investieren und unsere firmeneigene Bewertung der thematischen Ausrichtung durch die Nutzung unseres internen Researchs zur Kreislaufwirtschaft umfasst. Die firmeneigene Bewertung besteht darin, zwei Arten von Unternehmen zu identifizieren:

1. „Enabler“ mit einer Umsatzausrichtung von mindestens 20 % auf unsere firmeneigene Taxonomie der Kreislaufwirtschaft

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.

2. „Trailblazer“, die die Grundsätze der Kreislaufwirtschaft in ihren eigenen Betrieb integrieren, um eine höhere Finanz- und Nachhaltigkeitseffizienz zu erzielen, mit einem Mindest-Score von 30, gemessen mit unserem Bewertungstool für die Kreislaufwirtschaft.

Der ESG-Score des Portfolios ist höher als der gewichtete Durchschnitt der Bestandteile des MSCI AC World (der „Referenzwert“), nachdem 20 % der Emittenten mit den niedrigsten ESG-Scores, die sich im Referenzwert befinden, eliminiert wurden.



### Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Nachhaltigkeitsreferenzwert abgeschnitten?

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das nachhaltige Ziel des Finanzprodukts erreicht wird.

Nicht zutreffend.

- **Wie unterschied sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Nicht zutreffend.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf das nachhaltige Investitionsziel bestimmt wird?**

Nicht zutreffend.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Nicht zutreffend.

**Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 9 Absätze 1 bis 4 a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 5 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen 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.

**Name des Produkts:** HSBC GLOBAL INVESTMENT FUNDS - GLOBAL SUSTAINABLE LONG TERM EQUITY

**Unternehmenskennung (LEI-Code):** 213800T5TN9TXJMB1G69

## Nachhaltiges Investitionsziel

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

| <input checked="" type="checkbox"/> <input checked="" type="checkbox"/> <input checked="" type="checkbox"/> <b>Ja</b>                     | <input type="checkbox"/> <input type="checkbox"/> <input type="checkbox"/> <b>Nein</b>  |
|---|---|
| <input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel</b> getätigt: <b>98,22 %</b>        | <input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>ökologische/soziale Merkmale beworben</b> und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es <b>_ %</b> an nachhaltigen Investitionen |
| <input checked="" type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind       | <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind   |
| <input checked="" type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind   |
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit <b>nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel</b> getätigt: <b>_ %</b>                    | <input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel  |
|   | <input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine <b>nachhaltigen Investitionen getätigt</b>   |



### Inwieweit wurde das nachhaltige Investitionsziel dieses Finanzprodukts erreicht?

Während des Geschäftsjahres zum 31. März 2024 (der Bezugszeitraum) erreichte der Teilfonds Folgendes:

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die nachhaltigen Ziele dieses Finanzprodukts erreicht werden.

- Der Teilfonds investierte in ein konzentriertes Portfolio von Unternehmen, die aktiv zu den Zielen der Vereinten Nationen für nachhaltige Entwicklung beitragen, darunter unter anderem Maßnahmen zum Klimaschutz, bezahlbare und saubere Energie, sauberes Wasser und Sanitäreinrichtungen, Gesundheit und Wohlergehen sowie weniger Ungleichheiten.
- Der Teilfonds berücksichtigte verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Grundsätzen des Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC) und den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen. Wurden potenzielle Verstöße gegen die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC) festgestellt, wurden die Emittenten einer eigenen Due-Diligence-Prüfung hinsichtlich ESG-Themen unterzogen, um festzustellen, ob sie für die Aufnahme in das Portfolio des Fonds geeignet sind, und sie auszuschließen, falls sie als ungeeignet erachtet wurden.

3. Der Teilfonds schloss Geschäftstätigkeiten aus, die als umweltschädlich gelten, wie z. B. die Förderung von Kraftwerkskohle und die Kohleverstromung.
4. Der Teilfonds prüfte und analysierte alle Unternehmen oder Emittenten im Hinblick auf ökologische Merkmale, insbesondere physische Risiken durch den Klimawandel und Personalmanagement. Für die zugrunde liegenden E-, S- und G-Säulen wurden ein Screening sowie ein Vergleich mit dem für den Teilfonds definierten Referenzwert durchgeführt. „E“ und „S“ spiegeln die einzelnen Elemente des vom Teilfonds beworbenen nachhaltigen Anlageziels wider, „G“ die Unternehmensführungspraktiken, die die Interessen von Minderheitsaktionären schützen und langfristige nachhaltige Wertschöpfung fördern.
5. Der Teilfonds berücksichtigte aktiv ökologische und soziale Aspekte, indem er über unsere Engagement- und Stewardship-Teams Mitwirkung bei Emittenten umsetzte und sein Recht zur Stimmrechtsvertretung wahrnahm.
6. Der Teilfonds schloss nach entsprechender Analyse Anlagen in umstrittenen Waffen aus.

Die ESG-Scores stammen vom externen ESG-Datenanbieter MSCI. Die Berücksichtigung einzelner (in der nachstehenden Tabelle nummerierter) wichtigster nachteiliger Indikatoren (PAI) drückt sich darin aus, dass der Teilfonds niedrigere Werte als der Referenzwert aufweist. Die bei der Berechnung der PAI-Werte verwendeten Daten stammen von externen Datenanbietern. Sie können auf Unternehmensangaben basieren oder von den Datenanbietern geschätzt werden, wo keine solchen Angaben vorliegen. Bitte beachten Sie, dass es nicht immer möglich ist, die Richtigkeit, Aktualität oder Vollständigkeit der von Drittanbietern bereitgestellten Daten zu garantieren.

Das Abschneiden der Nachhaltigkeitsindikatoren, die der Teilfonds zur Messung der Erreichung des von ihm beworbenen nachhaltigen Anlageziels verwendet, ist in der folgenden Tabelle dargestellt. Es wurde auf das Erreichen eines ESG-Score des Teilfonds hingearbeitet, der über dem vom Teilfonds ausgewählten Referenzindex liegt (ein höherer Score als der Referenzwert bedeutet bessere ESG-Referenzen).

Alle Unternehmen haben eine gute Unternehmensführung bewiesen, was sich am PAI-Score 10 unten ablesen lässt.

### **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

| <b>Indikator</b>   | <b>Teilfonds</b> | <b>Referenzwert</b> |
|--|------------------|---------------------|
| ESG-Score  | 8,58             | 6,78                |
| E-Säule  | 6,90             | 6,66                |
| S-Säule  | 6,19             | 5,11                |
| G-Säule  | 6,34             | 5,65                |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO2-Äquivalente pro Million Euro Umsatz  | 34,46            | 126,54              |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 0,00 %           | 1,39 %              |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 0,00 %           | 0,22 %              |

Die Daten in diesem regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung beziehen sich auf den Stand vom 31. März 2024, basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des am 31. März 2024 endenden Geschäftsjahres.

Referenzwert – MSCI All Country World

### ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

| Indikator  | Zeitraum zum  | Teilfonds | Referenzwert |
|--|---------------|-----------|--------------|
| ESG-Score  | 31. März 2024 | 8,58      | 6,78         |
|  | 31. März 2023 | 8,51      | 6,82         |
| E-Säule  | 31. März 2024 | 6,90      | 6,66         |
|  | 31. März 2023 | 6,45      | 6,60         |
| S-Säule  | 31. März 2024 | 6,19      | 5,11         |
|  | 31. März 2023 | 6,22      | 5,16         |
| G-Säule  | 31. März 2024 | 6,34      | 5,65         |
|  | 31. März 2023 | 6,38      | 5,66         |
| 3. THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird – Tonnen CO <sub>2</sub> -Äquivalente pro Million Euro Umsatz   | 31. März 2024 | 34,46     | 126,54       |
|  | 31. März 2023 | 52,42     | 154,34       |
| 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen | 31. März 2024 | 0,00 %    | 1,39 %       |
|  | 31. März 2023 | 0,00 %    | 1,65 %       |
| 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   | 31. März 2024 | 0,00 %    | 0,22 %       |
|  | 31. März 2023 | 0,00 %    | 0,00 %       |

Da es sich erst um den zweiten regelmäßigen Bericht gemäß Offenlegungsverordnung handelt, ist kein Vergleich mit vorangegangenen Zeiträumen möglich.

### Inwiefern wurden nachhaltige Investitionsziele durch die nachhaltigen Investitionen nicht erheblich beeinträchtigt?

Wir bestätigen, dass wir nachhaltige Vermögenswerte darauf geprüft haben, ob sie erhebliche Beeinträchtigungen verursachen können. Dies erfolgte im Rahmen des Standard-Anlageprozesses von HSBC Asset Management (HSBC) und unter Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen.

#### *Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?*

Der Anlageberater hat alle durch die Offenlegungsverordnung definierten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI) auf ihre Relevanz für den Teilfonds geprüft. Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren legt fest, wie HSBC die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen identifiziert und darauf reagiert, und in welcher Form HSBC Nachhaltigkeitsrisiken berücksichtigt, die sich negativ auf Wertpapiere auswirken können, in die der Teilfonds investiert. HSBC identifizierte in Zusammenarbeit mit externen Screening-Dienstleistern, wie Sustainalytics, ISS, MSCI und Trucost, Unternehmen und Regierungen mit schlechter Bilanz beim Management von ESG-Risiken, und wo solche wesentlichen Risiken identifiziert wurden, führte HSBC zusätzliche ESG-Due-Diligence-Prüfungen durch. Durch Screening identifizierte Nachhaltigkeitsauswirkungen einschließlich der PAI bildeten einen Schlüsselfaktor beim Anlageentscheidungsprozess.

Der oben beschriebene Ansatz führte dazu, dass unter anderem folgende Faktoren geprüft wurden:

- Engagement der Unternehmen für den Übergang zu CO<sub>2</sub>-armen Wirtschaften, zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern, Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus großen Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails; und

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.



- Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit folgenden Bereichen: demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.

Die spezifischen PAI für diesen Teilfonds waren wie unten beschrieben.

Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren ist auf der Website [www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies](http://www.assetmanagement/hsbc/about-us/responsible-investing/policies) verfügbar.

*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:*

HSBC hat sich der Anwendung und Förderung globaler Standards verpflichtet. Die wichtigsten Schwerpunktbereiche der Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren entsprachen den zehn UNGC-Grundsätzen. Diese Grundsätze stehen in Zusammenhang mit nicht finanziellen Risiken in den Bereichen Menschenrechte, Arbeit, Umweltschutz und Korruptionsbekämpfung. HSBC gehört darüber hinaus zu den Unterzeichnern der UN Principles for Responsible Investment. Diese bildeten den Rahmen für Ermittlung und Management von Nachhaltigkeitsrisiken beim Investmentansatz von HSBC. Von Unternehmen, in die der Teilfonds investierte, wurde erwartet, dass sie die Anforderungen des UNGC und der damit verbundenen Standards erfüllen. Unternehmen, die belegbar gegen einen der zehn Grundsätze des UNGC verstießen, wurden systematisch ausgeschlossen. Der Teilfonds führte verstärkte Due-Diligence-Prüfungen bei Unternehmen durch, die als nicht konform mit den Prinzipien des UNGC angesehen wurden oder die nach den unternehmenseigenen ESG Ratings von HSBC als risikoreich angesehen wurden. Darüber hinaus wurden die Unternehmen nach internationalen Standards wie den OECD-Leitsätzen bewertet.



### **Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Der Teilfonds berücksichtigte die folgenden PAI, indem er sie als Nachhaltigkeitsindikatoren beobachtete:

- Treibhausgasintensität der Unternehmen, in die investiert wird
- Verstöße gegen die UNGC- und OECD-Grundsätze
- Anteil der Investitionen mit Beteiligung an umstrittenen Waffen

Der Ansatz zur Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI) beinhaltete unter anderem, dass HSBC das Engagement der Unternehmen für den Übergang zu CO<sub>2</sub>-armen Wirtschaften, die zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern sowie die Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette prüfte, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails. Ebenfalls berücksichtigt wurde das Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit den Bereichen demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.

Das Screening führte dazu, dass HSBC nicht in bestimmte Unternehmen und Emittenten investierte.



## Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der Investitionen** entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden: basierend auf dem Vier-Quartals-Durchschnitt der Positionen des Bezugszeitraums zum 31.03.2024

| Größte Investitionen     | Sektor                  | % der Vermögenswerte | Land                           |
|--------------------------|-------------------------|----------------------|--------------------------------|
| Microsoft Corporation    | Informationstechnologie | 8,92 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| ASML Holding NV          | Informationstechnologie | 8,58 %               | Niederlande                    |
| Intuit Inc.              | Informationstechnologie | 6,23 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Adobe Inc.               | Informationstechnologie | 6,12 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| MSCI Inc. Class A        | Finanzen                | 5,20 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Novo Nordisk A/S Class B | Gesundheitswesen        | 4,51 %               | Dänemark                       |
| Visa Inc. Class A        | Finanzen                | 4,47 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Zoetis, Inc. Class A     | Gesundheitswesen        | 4,44 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |
| Waters Corporation       | Gesundheitswesen        | 4,29 %               | Vereinigte Staaten von Amerika |

Barmittel und Derivate wurden nicht berücksichtigt

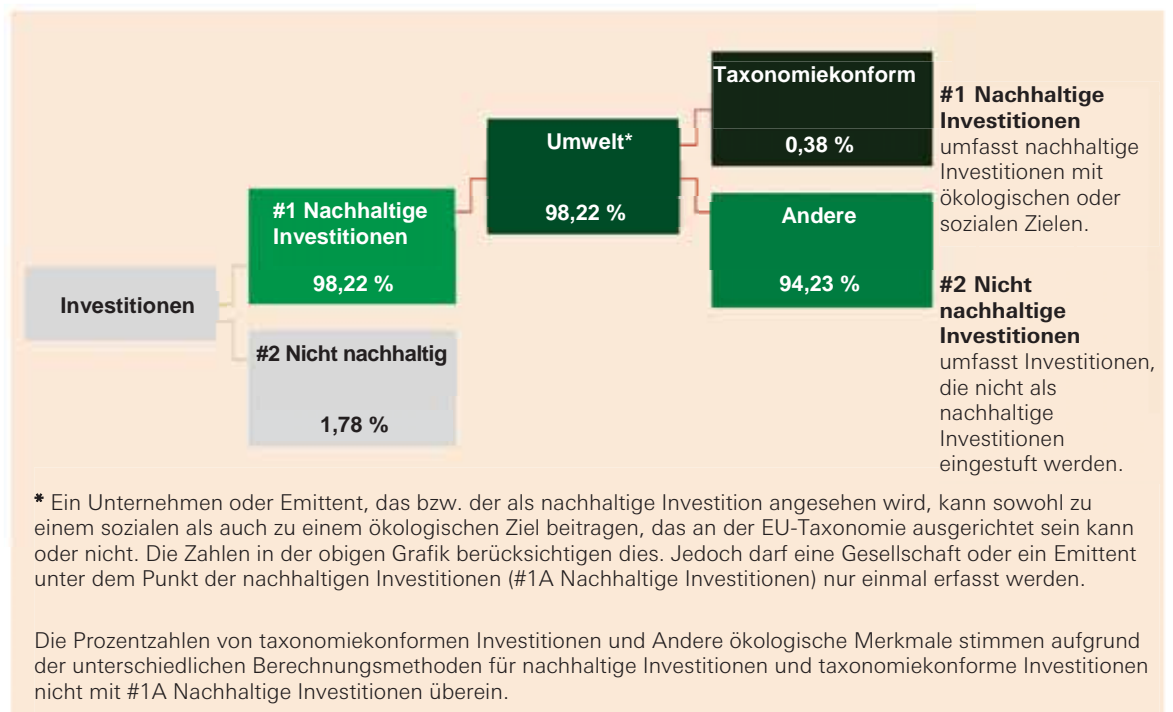


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

98,22 % des Portfolios waren in nachhaltige Vermögenswerte investiert.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?



### In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

| Sektor / Teilsektor     | % der Vermögenswerte |
|-------------------------|----------------------|
| Informationstechnologie | 31,34 %              |
| Gesundheitswesen        | 23,91 %              |
| Basiskonsumgüter        | 10,06 %              |

|                                |          |
|--------------------------------|----------|
| Finanzen                       | 9,34 %   |
| Grundstoffe                    | 8,35 %   |
| Industriegüter                 | 7,36 %   |
| Zyklische Konsumgüter          | 6,49 %   |
| Barmittel und Derivate         | 1,78 %   |
| Kommunikationsdienstleistungen | 1,36 %   |
| Summe                          | 100,00 % |

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO2-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.



## Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

Der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen ist in den obigen Feldern zur Vermögensallokation ersichtlich.

### Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

Ja:
  In fossiles Gas
  In Kernenergie

Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

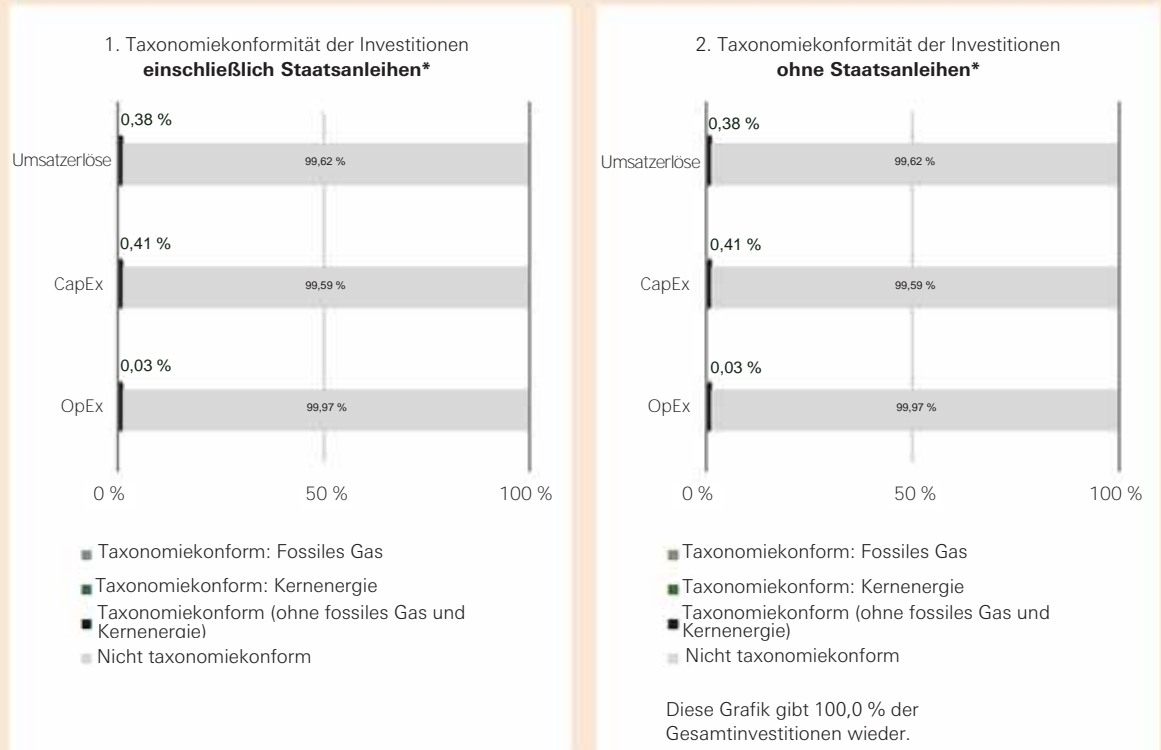
Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten 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 Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

**Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.**



\* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

**Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.


● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Im Referenzzeitraum betrug der Anteil der Investitionen des Fonds, die in Übergangstätigkeiten geflossen sind, 0,00 % und der Anteil der Investitionen, die in ermöglichende Tätigkeiten geflossen ist, 0,37 %.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

| Indikator   | 2023-2024 | 2022-2023 |
|---|-----------|-----------|
| Umsatz – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                       | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform: Kernenergie                        | n. z.     | 0,00 %    |
| Umsatz – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie) | 0,38 %    | 0,00 %    |
| Umsatz – Nicht taxonomiekonform                               | 99,62 %   | 100,00 %  |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                        | n. z.     | 0,00 %    |
| CAPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                         | n. z.     | 0,00 %    |
| CAPEX – Nicht taxonomiekonform                                | 99,59 %   | 100,00 %  |
| CAPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)  | 0,41 %    | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform: Fossiles Gas                         | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform: Kernenergie                          | n. z.     | 0,00 %    |
| OPEX – Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)   | 0,03 %    | 0,00 %    |
| OPEX – Nicht taxonomiekonform                                 | 99,97 %   | 100,00 %  |

Da es sich erst um den zweiten Berichtszeitraum des Teilfonds handelt, ist ein Vergleich mit der Zeit davor nicht erforderlich.


 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 nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden?**

Der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel war 94,23 %. Der Teilfonds hat sich nicht verpflichtet, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen.

 **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Teilfonds investierte in ein Portfolio von festverzinslichen Wertpapieren, die von Unternehmen ausgegeben wurden, die einen aktiven Beitrag zu den UN-SDGs leisteten und daher als soziale Elemente von Investitionen gelten, nämlich „Gesundheit und Wohlbefinden“, „Gleichstellung der Geschlechter“, „Menschenwürdige Arbeit und Wirtschaftswachstum“ sowie „Weniger Ungleichheiten“. Diese sozialen UN-SDGs wurden jedoch in Verbindung mit den ökologischen UN-SDGs betrachtet. Daher ist es nicht möglich, einen separaten Anteil sozial nachhaltiger Investitionen auszuweisen.

 **Welche Investitionen fallen unter „nicht nachhaltige Investitionen“, welcher Anlagezweck wird mit ihnen verfolgt und gibt es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

#2 Andere Investitionen umfasst die Finanzinstrumente, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden. In manchen Fällen ist dies auf die Nichtverfügbarkeit von Daten und Unternehmensmaßnahmen zurückzuführen. Diese Positionen unterlagen nach wie vor dem vollständigen Ausschluss-Screening von HSBC und wurden im Hinblick auf verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Prinzipien des UNGC und der OECD geprüft.

Der Teilfonds hielt Barmittel / Barmitteläquivalente (der Prozentsatz der gehaltenen Barmittel ist in der obigen Tabelle der Sektoren/Teilsektoren unter der Überschrift „In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?“ ersichtlich) zum Zwecke

des Liquiditätsmanagements sowie derivative Finanzinstrumente zum Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements. Barmittel / Barmitteläquivalente und derivative Finanzinstrumente verfügen aufgrund der Art dieser Instrumente über keinen ökologischen oder sozialen Mindestschutz.



## Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung des nachhaltigen Investitionsziels ergriffen?

Während des Bezugszeitraums hat die Strategie ihr nachhaltiges Investitionsziel erreicht, indem sie die Nachhaltigkeit des Geschäftsmodells, des Produkts und der Praktiken aller im Portfolio vertretenen Positionen genauestens bewertet hat. Darüber hinaus hat der Anlageberater durch seine Fundamentaldatenanalyse sichergestellt, dass jedes im Portfolio enthaltene Unternehmen mindestens ein Ziel der Vereinten Nationen für nachhaltige Entwicklung erfüllt.

Der Anlageberater bewertete die Unternehmen anhand einer firmeneigenen Scorecard, die drei Dimensionen der Nachhaltigkeit berücksichtigt: Praktiken und Kultur, Geschäftsmodell und Produkt.

Das UN-SDG-Mapping wurde vom Anlageberater durchgeführt und nicht davon beeinflusst, wie das jeweilige Unternehmen selbst seine Ausrichtung definiert. Das Investitionsteam legte eine Ausrichtungskennzahl für das SDG-Mapping und ein Ausgangsjahr für den Datenpunkt fest und verfolgte die Kennzahl über die Zeit hinweg. Das Team arbeitete mit mehreren Unternehmen speziell auf Grundlage dieser Kennzahl zusammen, um sicherzustellen, dass unsere Erwartungen über die Zeit hinweg erfüllt werden.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Nachhaltigkeitsreferenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend.

- **Wie unterschied sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**  
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf das nachhaltige Investitionsziel bestimmt wird?**  
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?**  
Nicht zutreffend.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**  
Nicht zutreffend.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das nachhaltige Ziel des Finanzprodukts erreicht wird.

HSBC Global Asset Management, der Initiator der HSBC Global Investment Funds, ist der Vermögensverwaltungsspezialist der HSBC-Gruppe und betreibt seine Geschäfte über HSBC Bank PLC und ihre Tochtergesellschaften.

HSBC Asset Management ist der Handelsname von HSBC Global Asset Management Limited. Die Geschäftsräume von HSBC Global Asset Management befinden sich an ihrem Sitz, 8 Canada Square, London E14 5HQ.

© Copyright. HSBC Global Asset Management Limited 2024. Alle Rechte vorbehalten 14846/0608